

Ohne Wirtschaftsdaten, wichtige Quartalsberichte oder öffentliche Auftritte von Mitgliedern der FED scheint die Wall Street nicht so recht zu wissen, was sie mit den Kursen machen soll. Der Handel gestern war übersichtlich und ruhig, von leichten Verlusten bis leichten Gewinnen alles dabei.

Der Handelsumsatz war an der Nasdaq höher und an der NYSE geringer gegenüber dem Vortag.

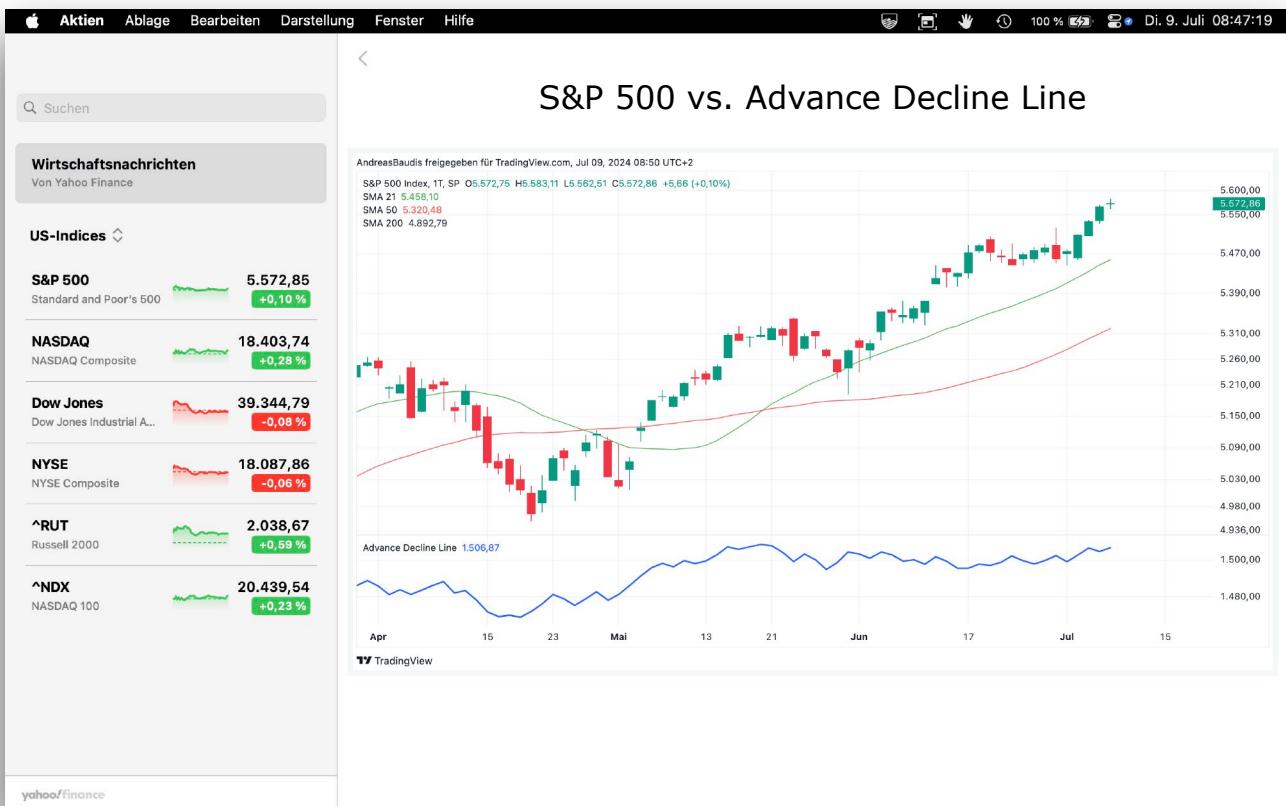
Das Verhältnis von Aktien mit neuem Hoch zu Aktien mit neuem Tief beträgt etwa 4,4 zu 1 (Quelle: [finviz.com](#)).

Der Gesamt-Markt bleibt im Aufwärtstrend. Möglicherweise kommt heute etwas Bewegung durch die anstehenden FED-Termine in den Markt.

Bedingungs-Order für die Index-Strategien:

TakeProfit bei einem SPX-Kurs von: 5.839,50 (fix)

StopLoss bei einem SPX-Kurs von: 5.321,50 (Notstopp, wird täglich und ausschließlich nach oben nachgezogen)



Wichtige Termine USA heute: keine

9. Juli 2024			
Rede des Vizevorsitzenden für Aufsicht der Fe...			
15:15	Aktuell	Prognose	Vorherige
Fed Vorsitzenden Powells Stellungnahme			
16:00	Aktuell	Prognose	Vorherige
EIA, Kurzfristiger Energie-Ausblick			
18:00	Aktuell	Prognose	Vorherige
Fed Governor Bowman spricht			
19:30	Aktuell	Prognose	Vorherige

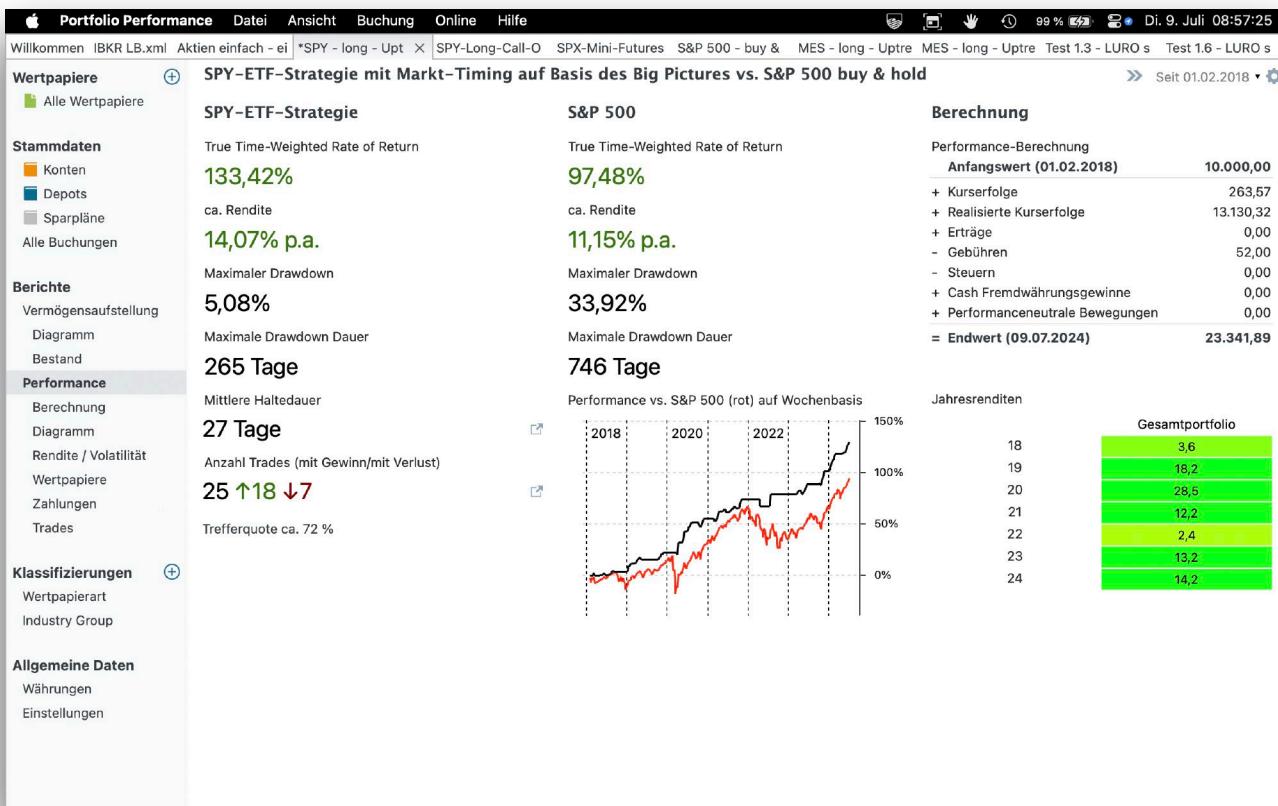
Die wichtigsten Quartalsergebnisse der Woche.

Most Anticipated Earnings Releases for the week beginning July 08, 2024									
Monday		Tuesday		Wednesday		Thursday		Friday	
Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	
 THE GREENBRIER COMPANIES		 HELEN OF TROY	 SGH	 THERA technologies	 WD-40 COMPANY	 PEPSI CO.		 JPMORGAN CHASE & CO.	
		 byrna	 KURA	 SARATOGA INVESTMENT CORP	 MANU	 PriceSmart	 AZZ	 CAG	 CONAGRA BANK
				 MAU	 ETWO	 E2OPEN	 DAL	 BANK	 BK
							 DELTA		 FASTENAL
								 ERICSSON	

<http://eps.sh/cal>

© 2024 Earnings Whispers

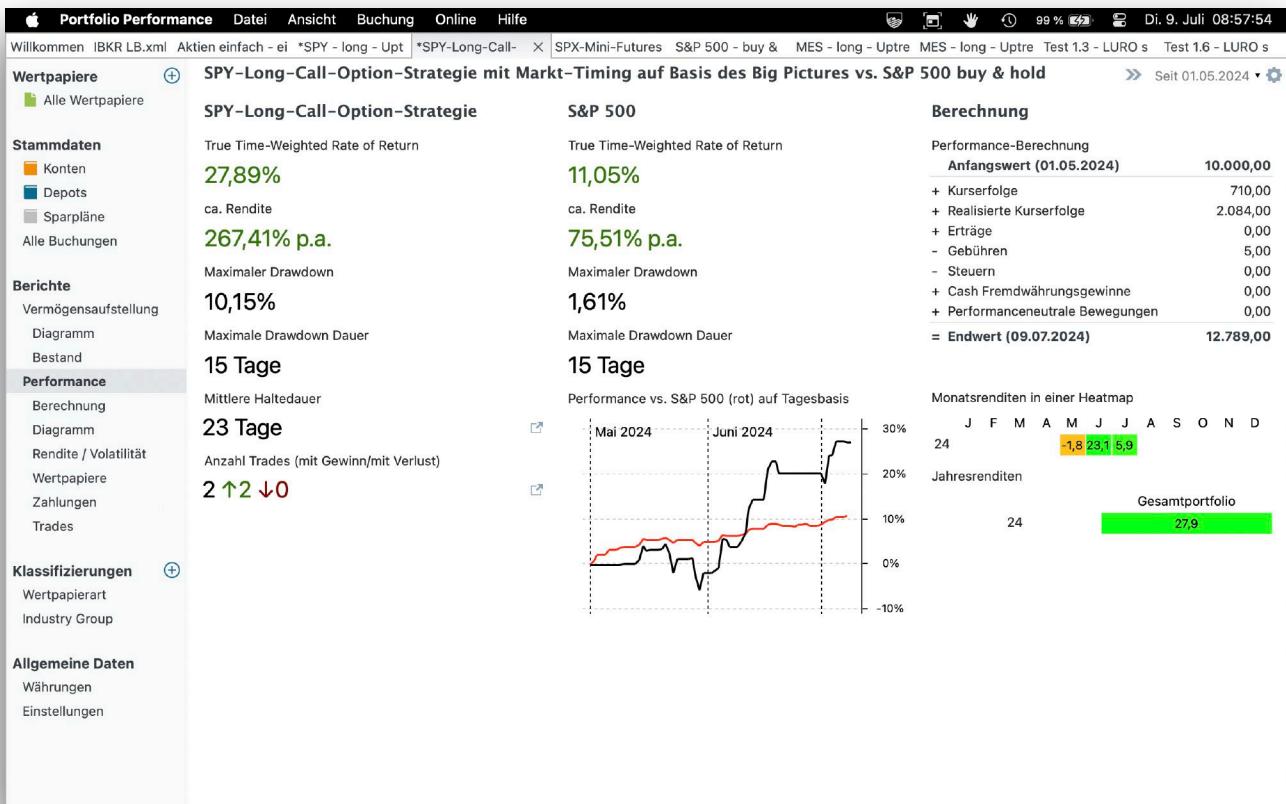
SPY-ETF-Strategie mit Markt-Timing auf Basis des Big Picture im Vergleich zu buy & hold im S&P 500 ab 01.02.2018. Für die ETF-Strategie sind zusätzliche Regeln für Gewinnmitnahmen und Verlustbegrenzung erforderlich. Die Strategie dient in erster Linie dem direkten Vergleich zwischen buy & hold und Markt-Timing.



Die letzten Transaktionen der SPY-ETF-Strategie.

Konten										
Konto	Kontostand	Währung	Notiz							
Cash	0,00	USD								
20.06.2024, 18:30	Kauf	SPY	42	549,01	-23.079,32	1,00	0,00	0,00	Big Picture ETF Strategie	
15.05.2024	Kauf	SPY	20,9	529,78	-11.085,70	1,00	0,00	0,00	Big Picture ETF Strategie	
09.05.2024	Kauf	SPY	21,3	520,17	-11.085,69	1,00	11.085,70	0,00	Big Picture ETF Strategie	
07.03.2024	Verkauf	SPY	43,1	514,81	22.171,39	1,00	22.171,39	0,00	Big Picture ETF Strategie	
08.01.2024	Kauf	SPY	43,1	474,60	-20.441,58	1,00	0,00	0,00	Big Picture ETF Strategie	
22.11.2023	Verkauf	SPY	44,9	455,02	20.441,58	1,00	20.441,58	0,00	Big Picture ETF Strategie	
01.11.2023	Kauf	SPY	44,9	422,66	-18.989,75	1,00	0,00	0,00	Big Picture ETF Strategie	
19.10.2023	Verkauf	SPY	44,5	426,43	18.989,75	1,00	18.989,75	0,00	Big Picture ETF Strategie	
06.10.2023	Kauf	SPY	44,5	429,54	-19.130,25	1,00	0,00	0,00	Big Picture ETF Strategie	
16.06.2023	Verkauf	SPY	43,5	439,46	19.130,25	1,00	19.130,25	0,00	Big Picture ETF Strategie	
17.05.2023	Kauf	SPY	43,5	415,23	-18.077,43	1,00	0,00	0,00	Big Picture ETF Strategie	
03.05.2023	Verkauf	SPY	44,3	408,02	18.077,43	1,00	18.077,43	0,00	Big Picture ETF Strategie	
27.04.2023	Kauf	SPY	44,3	412,41	-18.273,94	1,00	0,00	0,00	Big Picture ETF Strategie	
25.04.2023	Verkauf	SPY	45	406,08	18.273,94	1,00	18.273,94	0,00	Big Picture ETF Strategie	
29.03.2023	Kauf	SPY	45	401,35	-18.063,07	1,00	0,00	0,00	Big Picture ETF Strategie	
29.07.2022	Verkauf	SPY	43,8	411,99	18.063,07	1,00	18.063,07	0,00	Big Picture ETF Strategie	
15.07.2022	Kauf	SPY	43,8	385,13	-16.887,37	1,00	0,00	0,00	Big Picture ETF Strategie	
22.04.2022	Verkauf	SPY	39,6	426,04	16.887,37	1,00	16.887,37	0,00	Big Picture ETF Strategie	
19.04.2022	Kauf	SPY	39,6	445,04	-17.642,54	1,00	0,00	0,00	Big Picture ETF Strategie	
05.11.2021	Verkauf	SPY	37,7	468,52	17.642,54	1,00	17.642,54	0,00	Big Picture ETF Strategie	
14.10.2021	Kauf	SPY	37,7	442,50	-16.664,57	1,00	0,00	0,00	Big Picture ETF Strategie	
10.09.2021	Verkauf	SPY	37,4	445,44	16.664,57	1,00	16.664,57	0,00	Big Picture ETF Strategie	

SPY-Long-Call-Option-Strategie mit Markt-Timing auf Basis des Big Pictures im Vergleich zu buy & hold im S&P 500 ab 01.05.2024. Für die Options-Strategie sind analog zur ETF-Strategie zusätzliche Regeln für Gewinnmitnahmen und Verlustbegrenzung erforderlich.



Die letzten Transaktionen der SPY-Long-Call-Option-Strategie.

Wertpapiere	Konten
Stammdaten	Konto Kontostand Währung Notiz
Cash	10.175,00 USD
Berichte	Vermögensaufstellung
Performance	Berechnung
	Diagramm
	Rendite / Volatilität
	Wertpapiere
	Zahlungen
	Trades
Klassifizierungen	
Allgemeine Daten	

Cash									
Datum	Transaktion	Symbol	Stück (Anzahl x Faktor)	Orderkurs	Order-Betrag	Gebühren	Rest-Saldo	Cash	Strategie-Depot
02.07.2024	Kauf	SPY240830C00553000	200	9,52	-1.905,00	1,00	10.175,00		Big Picture Options Strategie
20.06.2024, 18:30	Verkauf	SPY240719C00525000	100	24,11	2.410,00	1,00	12.080,00		Big Picture Options Strategie
20.06.2024, 18:30	Verkauf	SPY240719C00535000	100	15,53	1.552,00	1,00	9.670,00		Big Picture Options Strategie
15.05.2024	Kauf	SPY240719C00535000	100	8,52	-853,00	1,00	8.118,00		Big Picture Options Strategie
09.05.2024	Kauf	SPY240719C00525000	100	10,28	-1.029,00	1,00	8.971,00		Big Picture Options Strategie
01.05.2024	Einlage				10.000,00		10.000,00		

SPX-Micro-Future-Strategie mit Markt-Timing auf Basis des Big Pictures im Vergleich zu buy & hold im S&P 500 ab 01.05.2024. Für die Future-Strategie sind analog zur ETF-Strategie zusätzliche Regeln für Gewinnmitnahmen und Verlustbegrenzung erforderlich.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

Willkommen IBKR LB.xml Aktien einfach - ei *SPY - long - Upt *SPY-Long-Call-*SPX-Mini-Future X S&P 500 - buy & MES - long - Uptre MES - long - Uptre Test 1.3 - LURO s Test 1.6 - LURO s

Di. 9. Juli 08:58:17

Wertpapiere + SPX-Micro-Future-Strategie mit Markt-Timing auf Basis des Big Pictures vs. buy & hold im S&P 500 Seit 01.05.2024

Stammdaten

- Konten 25,31%
- Depots
- Sparpläne
- Alle Buchungen

Berichte

- Vermögensaufstellung 8,71%
- Diagramm
- Bestand

Performance

- Berechnung 15 Tage
- Diagramm
- Rendite / Volatilität
- Wertpapiere
- Zahlungen
- Trades

Klassifizierungen + Wertpapierart

Allgemeine Daten Währungen Einstellungen

SPX-Micro-Future-Strategie

True Time-Weighted Rate of Return
25,31% ca. Rendite 229,86% p.a.

Maximaler Drawdown 8,71% Maximale Drawdown Dauer 15 Tage

Mittlere Haltedauer 23 Tage Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust) 1 ↑1 ↓0 (je volle 5.000 USD = 1 MES-Kontrakt)

S&P 500

True Time-Weighted Rate of Return
11,05% ca. Rendite 75,51% p.a.

Maximaler Drawdown 1,61% Maximale Drawdown Dauer 15 Tage

Berechnung

Performance-Berechnung

Anfangswert (01.05.2024)	10.000,00
+ Kurserfolge	662,50
+ Realisierte Kurserfolge	1.872,50
+ Erträge	0,00
- Gebühren	4,00
- Steuern	0,00
+ Cash Fremdwährungsgewinne	0,00
+ Performanceneutrale Bewegungen	0,00
= Endwert (09.07.2024)	12.531,00

Monatsrenditen in einer Heatmap

J F M A M J J A S O N D
24 0,9 176 5,6
Jahresrenditen 24 25,3
Gesamtportfolio 25,3

Die letzten Transaktionen der SPX-Micro-Future-Strategie.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

Willkommen IBKR LB.xml Aktien einfach - ei SPY - long - Upt SPY-Long-Call-O *SPX-Mini-Future X S&P 500 - buy & MES - long - Uptre MES - long - Uptre Test 1.3 - LURO s *Test 1.6 - LURO s

Mi. 3. Juli 11:12:42

Wertpapiere + Konten +

Stammdaten

- Konten
- Depots
- Sparpläne
- Alle Buchungen

Berichte

- Vermögensaufstellung
- Diagramm
- Bestand

Performance

- Berechnung
- Diagramm
- Rendite / Volatilität
- Wertpapiere
- Zahlungen
- Trades

Klassifizierungen + Wertpapierart

Allgemeine Daten Währungen Einstellungen

Konten

Konto	Kontostand	Währung	Notiz
Cash	-43.819,00	USD	

Cash

Datum	Transaktion	Symbol	Stück (Anzahl x Faktor)	Orderkurs	Positionsgröße	Gebühren	Rest-Saldo	Cash Strategie-Depot
02.07.2024	Kauf	MES=F	10	5.568,75	-55.688,50	1,00	-43.819,00	SPX Micro Future Strategie
20.06.2024, 18:30	Verkauf	MES=F	10	5.473,25	54.731,50	1,00	11.869,50	SPX Micro Future Strategie
15.05.2024	Kauf	MES=F	5	5.333,00	-26.666,00	1,00	-42.862,00	SPX Micro Future Strategie
09.05.2024	Kauf	MES=F	5	5.239,00	-26.196,00	1,00	-16.196,00	SPX Micro Future Strategie
01.05.2024	Einlage				10.000,00		10.000,00	SPX Micro Future Strategie

*** Anhang mit Erläuterungen ***

Verwendete Ticker-Symbole der Indices (in Klammern die Symbole auf TradingView, falls abweichend):

Hauptindices

S&P 500: SPX

Nasdaq Composite: NDQ (IXIC)

Dow Jones Index: DJIA (DJI)

Nebenindices

NYSE Composite Index: NYA

Russell 2000: RUT

Nasdaq 100: NDX

Verwendete Abkürzungen:

FTD: Follow Through Day gemäß IBD-Definition

D-Day: Distribution Day gemäß IBD-Definition

FED: amerikanische Notenbank

RSL 50: relative Stärke nach Levy auf Basis von 50 Tagen

ATH: All-Time-High

A/D-Linie: Advanced Decline Line

*** Das Big-Picture-Konzept - Stand: 05.07.2024 ***

Das hier verwendete Konzept zur Einschätzung des Gesamt-Markt-Trends hat seinen Ursprung im Buch „Wie man mit Aktien Geld verdient“ von William J. O’Neil und dem von ihm gegründeten Finanzverlag „Investors Business Daily“, kurz IBD, erreichbar unter www.investors.com.

Ich habe das Konzept seit 2018 für mich überarbeitet und das Regelwerk so angepasst, dass es nur minimalen Interpretationsspielraum gibt, d.h. alle Regeln rausgeschmissen, die nicht digital ja oder nein sind oder diese bei Bedarf entsprechend ersetzt. Durch die Überarbeitungen ergeben sich hin und wieder kleine Abweichungen gegenüber dem Original Big Picture von IBD, die aber nicht nennenswert sind.

Die Analyse erfolgt hauptsächlich im Tageschart und zur Unterstützung am Wochenende im Wochenchart.

Der Grundgedanke ist folgender: 3 von 4 Aktien folgen dem Gesamtmarkt. Als Gesamtmarkt werden hierbei die folgenden marktbreiten Indices verstanden: S&P 500, Nasdaq Composite, Dow Jones Industrial Average und ergänzend der Russell 2000. Ich selbst habe die Liste der Indices noch um den NYSE Composite und den Nasdaq 100 ergänzt. Ist in der täglichen Analyse von allen Indices die Rede ist, dann sind die hier 6 aufgeführten Indices gemeint.

Wenn der Gesamtmarkt nun auf breiter Front nach Süden zieht, sind die eigenen Aktien im Depot meist mit davon betroffen und werden mit runter gezogen (Gegenwind).

Von November 2007 bis März 2009 verlor der S&P 500 in der Spitze rund 57 %. In diesem Zeitraum haben auch Aktiendepot's, die ausschließlich auf Buy & Hold setzen stark an Wert verloren, was man emotional auch ertragen müssen muss.

Im Gegenzug ist es einfacher und mit weniger Risiko verbunden, wenn man einen Aufwärtstrend im Gesamtmarkt für den Kauf einzelner Aktien nutzt (Rückenwind).

Im Ergebnis der täglichen Analyse, die mit etwas Übung nur wenige Minuten dauert, gibt es drei Möglichkeiten mit entsprechender Handlungs-Empfehlung für Aktien von IBD:

- Aufwärtstrend: Investitionsgrad bis 100 %
- Verkaufsdruck: Investitionsgrad bis 50 %
- Korrektur (vorher Abwärtstrend benannt): Investitionsgrad 0 %

Ich habe die Erfahrung gemacht, dass es durchaus sinnvoller ist, schon beim Auftreten von ● Verkaufsdruck auf Investitionsgrad 0 % umzusteigen.

In 2023 hat IBD den Investitionsgrad etwas differenziert und wie folgt in 5 Stufen aufgeteilt (Beispiel, nicht aktuell):



Im Mai 2024 wurde erstmalig der Wechsel von der Korrektur in einen Markt mit Verkaufsdruck von IBD vorgenommen, d.h. von rot auf gelb. Der Investitionsgrad wurde dabei von 20 % bis 40 % auf 40 % bis 60 % angehoben.

Es ist jedoch nicht klar definiert, in welcher Marktphase welcher Investitionsgrad empfohlen wird. Daher bleibe ich bei der bewährten Methode.

Letztlich muss jeder Investor für sich entscheiden, in welcher Höhe er bei welcher Marktlage investiert sein will.

Alternativ zum Kaufen/Verkaufen kann man sein Depot auch mit den bekannten Mitteln absichern.

*** Strategie-Hinweise und Risikohinweis - Stand: 18.05.2024 ***

Das oben aufgeführte Big Picture und die Strategien stellen keine Handlungs-Empfehlung dar und dienen ausschließlich der Weiterbildung. Ich übernehme keine Haftung für Trades, die auf Basis meiner Einschätzungen durchgeführt werden. Auch habe ich keine gesetzlich vorgeschriebene Zulassung für Beratung in Wertpapieren und Börsenhandel.

Zur SPY-ETF-Strategie:

- Die Transaktionen werden im Regelfall zu Börsenschluss-Kursen ausgeführt.
- Es werden Bruchstücke des SPY gehandelt, damit eine 100 %ige Investition möglich ist.
- Je Transaktion wird 1 USD Brokergebühren berücksichtigt.
- Es werden keine Steuern berücksichtigt.

Zur SPY-Options-Strategie:

- Die Transaktionen werden im Regelfall zu Börsenschluss-Kursen ausgeführt.
- Eckdaten für die Auswahl der Option:
 - ◆ Delta ca.: 0,5 (gemäß Anzeige in der TWS)
 - ◆ Anzahl offener Kontrakte: mind. 200
 - ◆ Restlaufzeit: im Regelfall ca. 90 Tage, jedoch mind. 60 Tage
- Die für die Darstellung verwendete Software Portfolio Performance kann den Faktor 100 bei Optionen nicht korrekt abbilden. Daher wird als Stückzahl für 1 Option in Portfolio Performance 100 Stück angegeben, um die Gewinn- und Verlust-Rechnung korrekt zu berechnen.
- Je Transaktion in 1 Option wird 1 USD Brokergebühren berücksichtigt.
- Es werden keine Steuern berücksichtigt.
- Da Optionen gehebelte Finanzinstrumente sind, wird die Strategie nie zu 100 % investiert sein. Mit Beginn der Investition am 09.05.2024 wird auch erst einmal die kleinstmögliche Anzahl in Optionskontrakte investiert. Sobald nennenswerte Gewinne erwirtschaftet wurden, kann die Anzahl der Kontrakte erhöht werden. Es geht darum langsam in das Risiko hineinzuwachsen.
- Da es sich bei Optionen um gehebelte Finanzinstrumente handelt, muss man auch mit einer höheren Volatilität im Handelskonto rechnen, no risk, no money!

Zur SPX-Mini-Future-Strategie

- Die Transaktionen werden im Regelfall zu Börsenschluss-Kursen ausgeführt.
- Die für die Darstellung verwendete Software Portfolio Performance kann den Faktor 5 bei den Future-Kontrakten nicht korrekt abbilden. Daher wird als Stückzahl für 1 Future-Kontrakt in Portfolio Performance 5 Stück angegeben, um die Gewinn- und Verlust-Rechnung korrekt zu berechnen.
- Portfolio Performance kann auch den Margin-Handel nicht korrekt abbilden, so dass beim Kauf von Future-Kontrakten das Cash-Konto immer haushoch imSoll steht.
- Je Transaktion in 1 Future-Kontrakt wird 1 USD Brokergebühren berücksichtigt.
- Es werden keine Steuern berücksichtigt.
- Da Futures gehebelte Finanzinstrument sind, wird die Strategie nie zu 100 % investiert sein. Mit Beginn der Investition am 09.05.2024 wird auch erst einmal die kleinstmögliche Anzahl in Future-Kontrakte investiert. Sobald nennenswerte Gewinne erwirtschaftet wurden, kann die Anzahl der Kontrakte erhöht werden. Es geht darum langsam in das Risiko hineinzuwachsen.
- Da es sich bei Future-Kontrakte um gehebelte Finanzinstrumente handelt, muss man auch mit einer höheren Volatilität im Handelskonto rechnen, no risk, no money!

Ideen und Kritik zu Verbesserung sind herzlich willkommen.

👉 Let's rock the Wall Street and may the force of money be with you! 🤘