

Zum Wochenschluss der vergangenen Woche ein marktbreiter solider Rebound an der Wall Street, wobei die Tageshöchstkurse nicht gehalten werden konnten. In der letzten halben Handelsstunde gaben die Indices mind. die Hälfte der vorher erreichten Tagesgewinne wieder ab und schlossen überwiegend in der unteren Hälfte der Tagesspanne. SPY, DJIA und NYA konnten Intraday neue ATH's markieren.

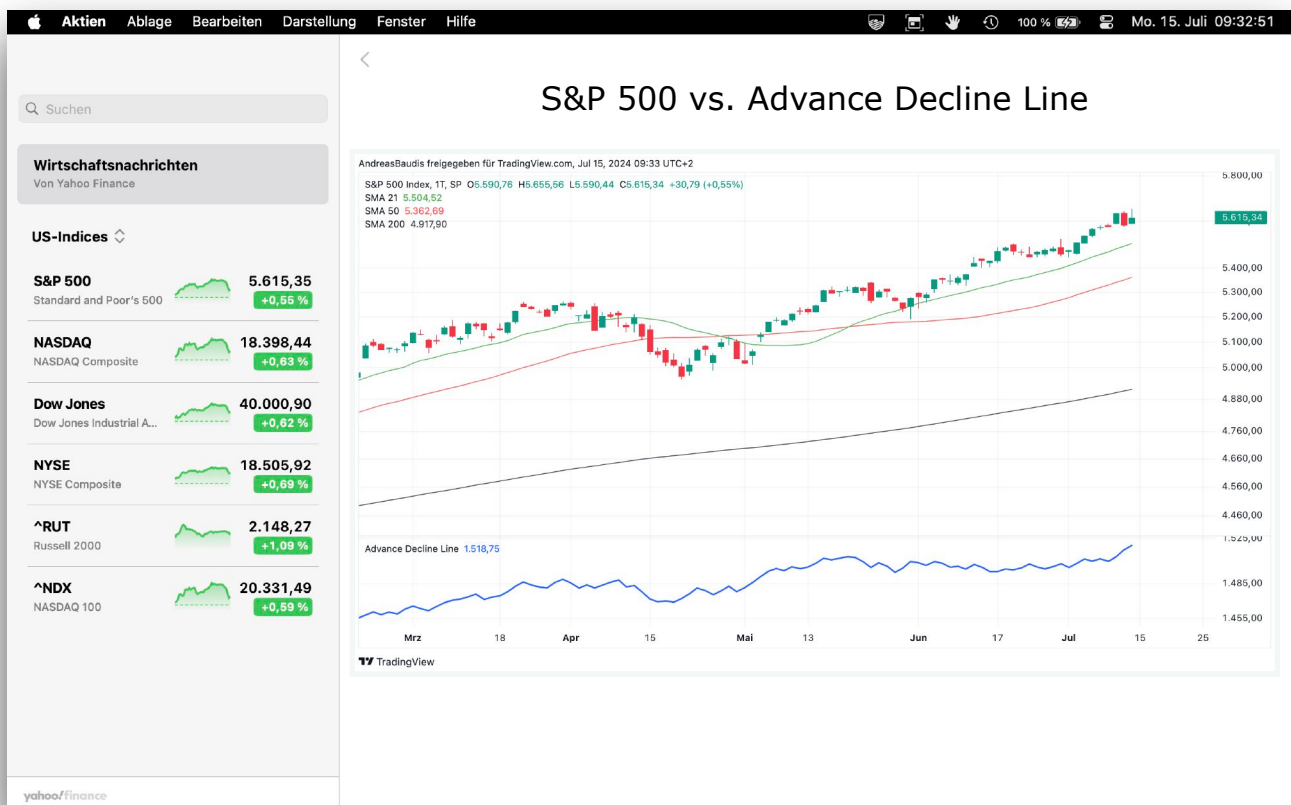
Der Handelsumsatz war an der Nasdaq und an der NYSE geringer gegenüber dem Vortag und auch geringer gegenüber dem Durchschnitt.

Das Verhältnis von Aktien mit neuem Hoch zu Aktien mit neuem Tief beträgt etwa 17 zu 1. Das Verhältnis von Aktien mit einem Kursgewinn zu Aktien mit einem Kursverlust beträgt ca. 3,7 zu 1 (Quelle beides: finviz.com).

Auf Wochenbasis legten die Indices bei höherem Umsatz überwiegend leicht, der RUT sogar sehr kräftig zu.

Der Gesamt-Markt bleibt im Aufwärtstrend und wir können gespannt sein, wie der Markt heute mit dem Attentat auf Ex-Präsident Donald Trump umgehen wird. Die Tagesschau berichtet, dass die Börsen bereits Trumps gestiegene Wahlchancen einpreisen und die US-Index-Future-Kurse liegen aktuell leicht im Gewinn. Aber Achtung: bis zum regulären Handel ab 15:30 Uhr kann sich noch alles ändern.

Die Index-Strategien sind zu 100 % in Cash und warten auf die nächste Gelegenheit zum Einstieg.



Wichtige Termine USA heute:

15. Juli 2024			
NY Empire-State-Index des verarbeitenden Ge...			
	–	–7.5	–6
14:30	Aktuell	Prognose	Vorherige
Rede des Vorsitzenden der Fed Powell			
	–	–	–
18:30	Aktuell	Prognose	Vorherige

Die wichtigsten Quartalsergebnisse der Woche.

E EARNINGS WHISPERS		Most Anticipated Earnings Releases									
		for the week beginning									
		July 15, 2024									
Monday		Tuesday		Wednesday		Thursday		Friday			
Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	After Close		
 BLK	 CFB	 UBH	 IBRT	 JNJ	 AA	 NOK	 SRG	 SLB			
 GNY	 SFB	 PGR	 AEHR	 ELV	 DFS	 CTAS	 PPG	 BMR			
 GNTY	 SFB	 MS	 W	 ALLY	 KMI	 DPZ	 OCFC	 BMR			
		 SCHW	 GABC	 PLD	 CC	 AIR	 FITB				
		 PNC	 FULT	 SYF	 STLD	 ABT	 MCB				
		 STT	 EQBK	 USB	 SLG	 BK	 CMA				
		 ANGO	 PNFP	 FCCO	 EFX	 SFG	 TRV				
		 MEWM	 CMC	 FIN	 FR	 INFY	 SCHL	 HBAN			
		 OmnicomGroup		 NTRS	 LBRT	 MMC	 RGP	 RF			
				 NTRS	 LBRT	 MMC	 RGP	 RF			
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.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

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

Wertpapiere + **Konten**

Alle Wertpapiere

Stammdaten

- Konten
- Depots
- Sparpläne
- Alle Buchungen

Berichte

- Vermögensaufstellung
- Diagramm
- Bestand
- Performance**
- Berechnung
- Diagramm
- Rendite / Volatilität
- Wertpapiere
- Zahlungen
- Trades

Klassifizierungen +

- Wertpapierart
- Industry Group

Allgemeine Daten

- Währungen
- Einstellungen

Konten

Konto Kontostand Währung Notiz

Cash	23.398,48	USD	
------	-----------	-----	--

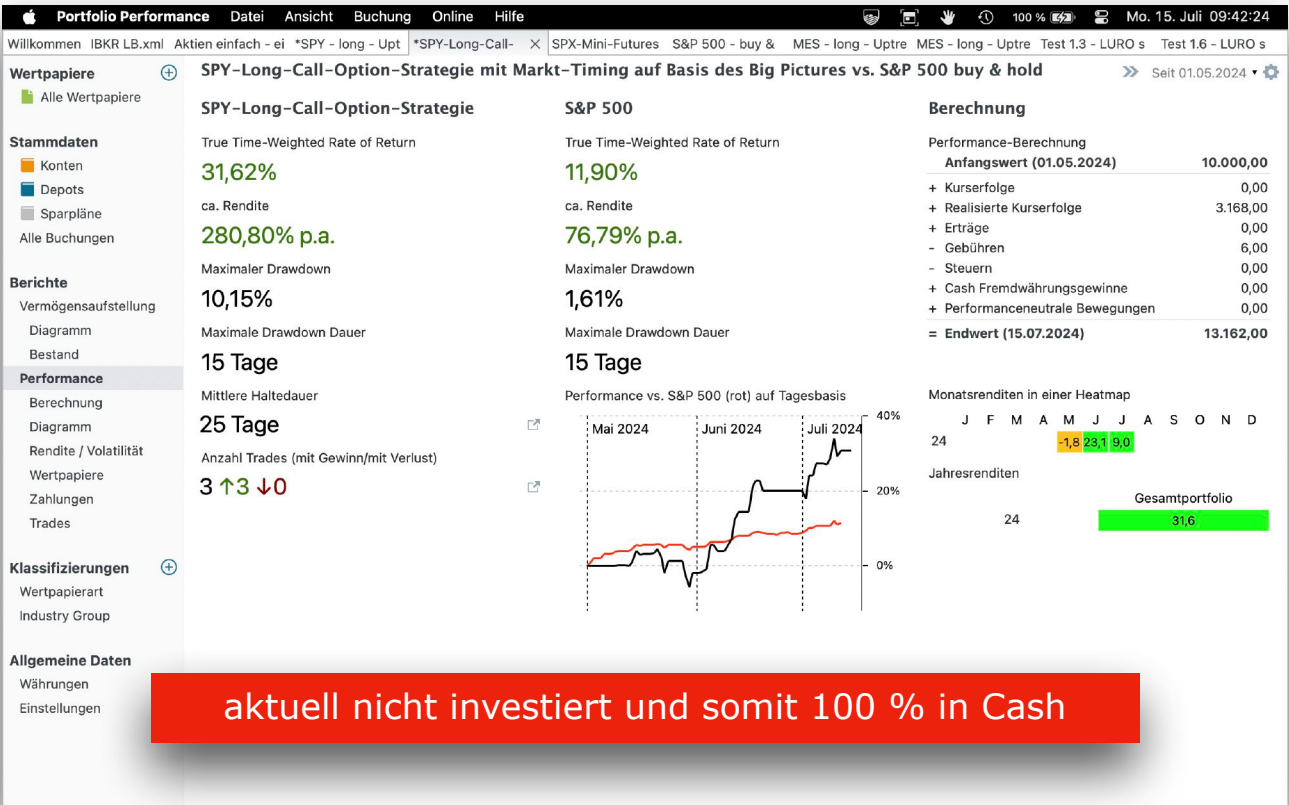
Cash

Umsätze Kontosaldenverlauf

Datum Transaktion Symbol Stück Orderkurs Order-Betrag Gebühren Rest-Saldo Cash Strategie-Depot

11.07.2024, 17:41	Verkauf	SPY	42	556,65	23.398,48	1,00	23.398,48	Big Picture ETF Strategie
02.07.2024	Kauf	SPY	42	549,01	-23.079,32	1,00	0,00	Big Picture ETF Strategie
20.06.2024, 18:30	Verkauf	SPY	42,2	546,50	23.079,32	1,00	23.079,32	Big Picture ETF Strategie
15.05.2024	Kauf	SPY	20,9	529,78	-11.085,70	1,00	0,00	Big Picture ETF Strategie
09.05.2024	Kauf	SPY	21,3	520,17	-11.085,69	1,00	11.085,70	Big Picture ETF Strategie
07.03.2024	Verkauf	SPY	43,1	514,81	22.171,39	1,00	22.171,39	Big Picture ETF Strategie
08.01.2024	Kauf	SPY	43,1	474,60	-20.441,58	1,00	0,00	Big Picture ETF Strategie
22.11.2023	Verkauf	SPY	44,9	455,02	20.441,58	1,00	20.441,58	Big Picture ETF Strategie
01.11.2023	Kauf	SPY	44,9	422,66	-18.989,75	1,00	0,00	Big Picture ETF Strategie
19.10.2023	Verkauf	SPY	44,5	426,43	18.989,75	1,00	18.989,75	Big Picture ETF Strategie
06.10.2023	Kauf	SPY	44,5	429,54	-19.130,25	1,00	0,00	Big Picture ETF Strategie
16.06.2023	Verkauf	SPY	43,5	439,46	19.130,25	1,00	19.130,25	Big Picture ETF Strategie
17.05.2023	Kauf	SPY	43,5	415,23	-18.077,43	1,00	0,00	Big Picture ETF Strategie
03.05.2023	Verkauf	SPY	44,3	408,02	18.077,43	1,00	18.077,43	Big Picture ETF Strategie
27.04.2023	Kauf	SPY	44,3	412,41	-18.273,94	1,00	0,00	Big Picture ETF Strategie
25.04.2023	Verkauf	SPY	45	406,08	18.273,94	1,00	18.273,94	Big Picture ETF Strategie
29.03.2023	Kauf	SPY	45	401,35	-18.063,07	1,00	0,00	Big Picture ETF Strategie
29.07.2022	Verkauf	SPY	43,8	411,99	18.063,07	1,00	18.063,07	Big Picture ETF Strategie
15.07.2022	Kauf	SPY	43,8	385,13	-16.887,37	1,00	0,00	Big Picture ETF Strategie
22.04.2022	Verkauf	SPY	39,6	426,04	16.887,37	1,00	16.887,37	Big Picture ETF Strategie
19.04.2022	Kauf	SPY	39,6	445,04	-17.642,54	1,00	0,00	Big Picture ETF Strategie
05.11.2021	Verkauf	SPY	37,7	468,52	17.642,54	1,00	17.642,54	Big Picture ETF Strategie
14.10.2021	Kauf	SPY	37,7	442,50	-16.664,57	1,00	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.

The screenshot displays the 'Konten' (Accounts) section of the 'Portfolio Performance' software. It shows the current cash balance and a list of transactions for the 'Big Picture Options Strategie'.

Konto	Kontostand	Währung	Notiz
Cash	13.162,00	USD	

Cash

Umsätze Kontosaldenverlauf

Datum	Transaktion	Symbol	Stück (Anzahl x Faktor)	Orderkurs	Order-Betrag	Gebühren	Rest-Saldo Cash	Strategie-Depot
12.07.2024, 17:41	Verkauf	SPY240830C00553000	200	14,94	2.987,00	1,00	13.162,00	Big Picture Options Strategie
02.07.2024	Kauf	SPY240830C00553000	200	9,52	-1.905,00	1,00	10.176,00	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.



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

Portfolio Performance

Willkommen *IBKR LB.xml Aktien einfach - ei SPY - long - Uptre *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

Fr. 12. Juli 10:39:08

Wertpapiere

Alle Wertpapiere

Stammdaten

Konten

Depots

Sparpläne

Alle Buchungen

Berichte

Vermögensaufstellung

Diagramm

Bestand

Performance

Berechnung

Diagramm

Rendite / Volatilität

Wertpapiere

Zahlungen

Trades

Klassifizierungen

Wertpapierart

Industry Group

Allgemeine Daten

Währungen

Einstellungen

Konto

Kontostand Währung Notiz

Cash

12.565,00 USD

Cash

Umsätze Kontosalldenverlauf

Datum Transaktion Symbol Stück (Anzahl x Faktor) Orderkurs Positionsgröße Gebühren Rest-Saldo Cash Strategie-Depot

11.07.2024, 17:41	Verkauf	MES=F	10	5.638,50	56.384,00	1,00	12.565,00	SPX Micro Future Strategie
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	

*** 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 können 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- und Risikohinweise - 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! 👉