

Erneut sehr kräftige Kursgewinne gestern an der Wall Street für den Nebenwerte-Index RUT. Auch der DJIA konnte kräftige Kursgewinne verbuchen. Die technologie-lastigen Indices NDQ und NDX liefen den starken Gewinnern hinterher und konnten nur leicht zulegen.

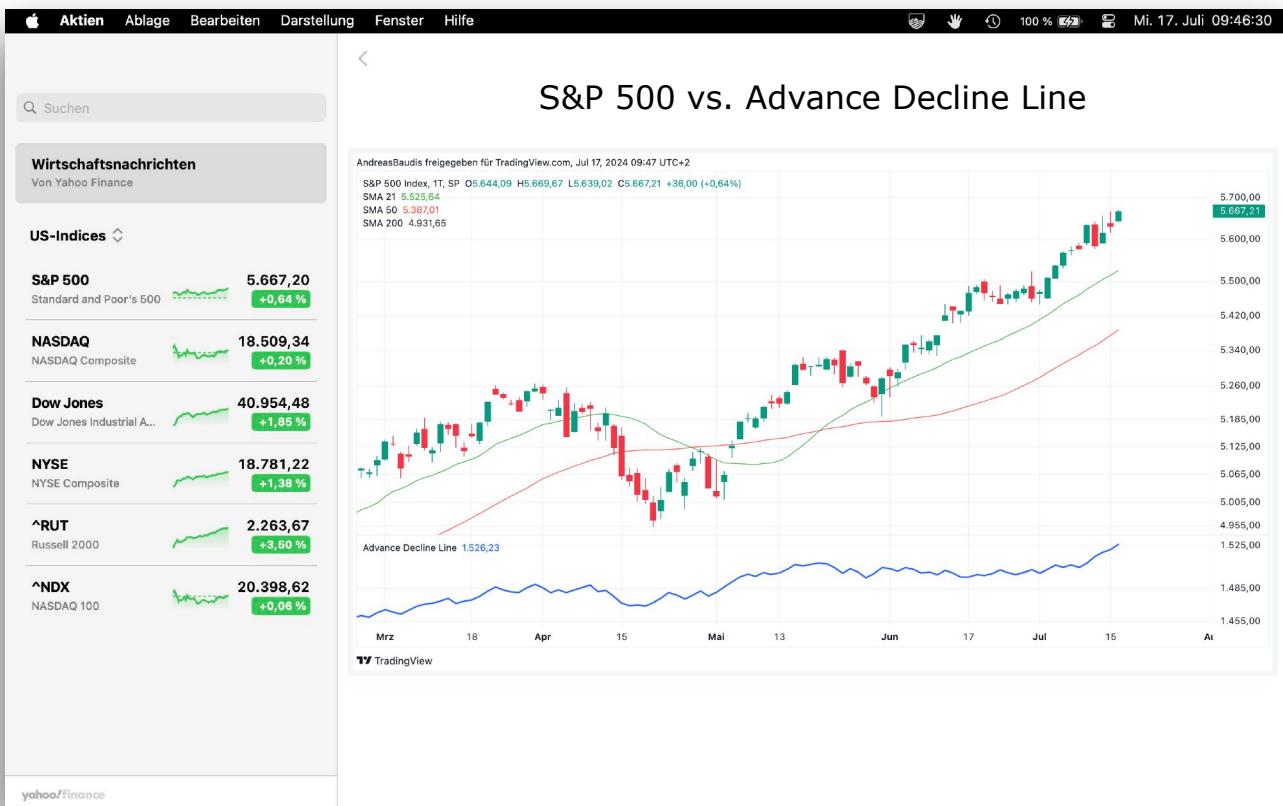
Der Handelsumsatz war an der Nasdaq und an der NYSE höher gegenüber dem Vortag und an der NSYE auch höher gegenüber dem Durchschnitt.

Das Verhältnis von Aktien mit neuem Hoch zu Aktien mit neuem Tief beträgt 25 zu 1! Das Verhältnis von Aktien mit einem Kursgewinn zu Aktien mit einem Kursverlust beträgt ca. 4,9 zu 1 (Quelle beides: finviz.com).

Durch die Nebenwerte-Rallye setzte sich der RUT innerhalb von nur 4 Handelstagen vom letzten Platz an die Spitze der Indices auf Basis der relativen Stärke von 50 Handelstagen und zog damit auch mit deutlichem Abstand an NDQ und NDX vorbei - Technologie-Aktien stehen seit einigen Tagen nicht mehr so hoch im Kurs. Angefeuert wird die Rallye durch weiter fallende Zinsen. SPX, DJIA und NYA erreichten gestern auf Schlusskursbasis neue ATH's.

Der Gesamt-Markt ist stark und bleibt im Aufwärtstrend. Die aktuell bestätigte Aufwärtsrallye läuft bereits seit 42 Handelstagen, so dass man mit einer Abkühlung rechnen sollte. Die schwächer werdenden Technologie-Werte scheinen dies bereits anzudeuten. Hinzu kommt, dass die nächsten Monate August und September saisonal eher schwache Börsenmonate sind.

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



Wichtige Termine USA heute:

17. Juli 2024			
Baubeginne			
	–	1.421 M	1.277 M
14:30	Aktuell	Prognose	Vorherige
Baugenehmigungen			
	–	1.443 M	1.386 M
14:30	Aktuell	Prognose	Vorherige
Baubeginne m/m			
	–	-8.0%	-5.5%
14:30	Aktuell	Prognose	Vorherige
Baugenehmigungen, m/m			
	–	-0.3%	-3.8%
14:30	Aktuell	Prognose	Vorherige
Fed, Industrieproduktion m/m			
	–	0.6%	0.9%
15:15	Aktuell	Prognose	Vorherige
Fed Industrieproduktion y/y			
	–	0.9%	0.4%
15:15	Aktuell	Prognose	Vorherige
Fed Präsident Waller spricht			
	–	–	–
15:35	Aktuell	Prognose	Vorherige
Fed Beige Book			
	–	–	–
20:00	Aktuell	Prognose	Vorherige

Die wichtigsten Quartalsergebnisse der Woche.

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	Before Open
[GS] Goldman Sachs	[FBK] FirstBank	[BAC] BANK OF AMERICA	[IBKR] Interactive Brokers	[ASML] ASML	[UAL] UNITED	[TSM] tsmc	[NFLX] NETFLIX	[AXP] AMERICAN EXPRESS	
[BLK] BlackRock	[CFB] CROSSFIRST BANKSHARES, INC.	[UNH] UNITEDHEALTH GROUP	[J.B. HUNT] J.B. HUNT	[JNJ] Johnson & Johnson	[AA] Alcoa	[NOK] NOKIA	[ISRG] INTUITIVE SURGICAL	[SLB] slb	
[GNY] Guaranty Bank & Trust	[SFB] ServisFirst Bank	[PROGRESSIVE] PROGRESSIVE	[AEHR] AEHR TEST SYSTEMS	[ELV] Elevance Health	[DISCOVER] DISCOVER	[CTAS] CINTAS	[PPG] PPG	[BMI] Badger Meter, Inc.	
[BLK] Morgan Stanley	[SCHW] Charles Schwab	[MS] Morgan Stanley	[HWG] GREAT SOUTHERN BANK	[ALLY] ally	[KMI] KINDER MORGAN	[DPZ] DR HORTON	[OCFC] OceanFirst Bank	[ALV] Autoliv	
[PNC] PNC	[STT] STATE STREET	[PNC] PNC	[FULT] FULTON FINANCIAL CORPORATION	[PROLOGIS] PROLOGIS	[SLG] CROWN CASTLE	[ABT] AAR	[AIR] FIFTH THIRD BANK	[HAL] HALLIBURTON	
[STT] angioDynamics	[MBWM] Mercantile Bank Corporation	[PNFP] BANCSHARES, INC.	[EQBK] EQUITY BANCSHARES, INC.	[USB] synchrony	[SLG] Steel Dynamics, Inc.	[BX] Abbott	[MCB] Metropolitan Commercial Bank	[CMA] Comerica	
[OMC] OmnicomGroup		[FCCO] Pinnacle FINANCIAL PARTNERS	[FHC] FIRST HORIZON NATIONAL CORPORATION	[FCCO] First Community Corporation	[EFX] EQUIFAX	[HFFY] Infosys	[SOFG] KeyBank	[TRV] TRAVELERS	
				[FIN] NORTHERN TRUST	[FR] FIRST INDUSTRIAL FINANCIAL TRUST	[KEY] SCHOLASTIC	[MMC] RGP	[HBAN] Huntington	
					[LIBRT] LIBERTY OUTLINE SERVICES	[PINE] Regions			
© 2024 Earnings Whispers									
http://eps.sh/cal									

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.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

Willkommen *IBKR LB.xml *SPY - long - Uptr X SPY-Long-Call-Opti SPX-Mini-Futures@ S&P 500 - buy & hol MES - long - Uptren MES - long - Uptren Test 1.3 - LURO shor Test 1.6 - LURO shor

100 % Mi. 17. Juli 10:13:06

Wertpapiere + **SPY-ETF-Strategie mit Markt-Timing auf Basis des Big Pictures vs. S&P 500 buy & hold** Seit 01.02.2018

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

SPY-ETF-Strategie

True Time-Weighted Rate of Return **133,98%**

ca. Rendite **14,06% p.a.**

Maximaler Drawdown **5,08%**

Maximale Drawdown Dauer **265 Tage**

Mittlere Haltedauer **27 Tage**

Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust) **26 ↑19 ↓7**

Trefferquote ca. 72 %

S&P 500

True Time-Weighted Rate of Return **100,82%**

ca. Rendite **11,40% p.a.**

Maximaler Drawdown **33,92%**

Maximale Drawdown Dauer **746 Tage**

Berechnung

Performance-Berechnung

Anfangswert (01.02.2018) **10.000,00**

+ Kurserfolge **0,00**

+ Realisierte Kurserfolge **13.451,48**

+ Erträge **0,00**

- Gebühren **53,00**

- Steuern **0,00**

+ Cash Fremdwährungsgewinne **0,00**

+ Performance neutrale Bewegungen **0,00**

= Endwert (17.07.2024) **23.398,48**

Jahresrenditen

Gesamtporfolio

2018: 18,2

2019: 28,5

2020: 12,2

2021: 2,4

2022: 13,2

2023: 14,6

aktuell nicht investiert und somit 100 % in Cash

Die letzten Transaktionen der SPY-ETF-Strategie.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

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

100 % Fr. 12. Juli 10:15:49

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

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	23.398,48	Big Picture ETF Strategie
02.07.2024	Kauf	SPY	42	549,01	-23.079,32	1,00	0,00	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	23.079,32	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	11.085,70	Big Picture ETF Strategie
07.03.2024	Verkauf	SPY	43,1	514,81	22.171,39	1,00	22.171,39	22.171,39	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	20.441,58	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	18.989,75	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	19.130,25	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	18.077,43	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	18.273,94	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	18.063,07	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	16.887,37	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	17.642,54	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

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.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

Willkommen *IBKR LB.xml *SPY - long - Uptr *SPY-Long-Call-Opt X SPX-Mini-Futures@ S&P 500 - buy & hol MES - long - Uptrn MES - long - Uptrn Test 1.3 - EURO shor Test 1.6 - EURO shor

Wertpapiere + SPY-Long-Call-Option-Strategie mit Markt-Timing auf Basis des Big Pictures vs. S&P 500 buy & hold Seit 01.05.2024

Stammdaten True Time-Weighted Rate of Return 31,62% 12,93% Berechnung Performance-Berechnung Anfangswert (01.05.2024) 10.000,00

Konten ca. Rendite 267,80% p.a. 79,31% p.a. + Kurserfolge 0,00

Depots ca. Rendite 10,15% 1,61% + Realisierte Kurserfolge 3.168,00

Sparpläne Maximaler Drawdown 24,70% 1,61% - Erträge 0,00

Alle Buchungen Maximale Drawdown Dauer 15 Tage 15 Tage - Gebühren 6,00

Berichte Vermögensaufstellung Maximale Drawdown Dauer 10,15% 1,61% - Steuern 0,00

Diagramm Bestand Maximale Drawdown Dauer 24 Tage 15 Tage + Cash Fremdwährungsgewinne 0,00

Bestand 15 Tage Maximale Drawdown Dauer 10,15% 1,61% + Performanceneutrale Bewegungen 0,00

Performance Berechnung = Endwert (17.07.2024) 13.162,00

Diagramm Rendite / Volatilität 24 Tage 15 Tage

Wertpapiere Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust) 3 ↑ 3 ↓ 0 Monatsrenditen in einer Heatmap

Zahlungen 24 Mai 2024 Juni 2024 Juli 2024 -1,8 2,3 1,9 0

Trades Jahresrenditen 24 31,6

Klassifizierungen + Wertpapierart Gesamtportfolio

Wertpapierart Industry Group

Allgemeine Daten Währungen

Währungen Einstellungen

aktuell nicht investiert und somit 100 % in Cash

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

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

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

Wertpapiere + Konten

Konten Kontostand Währung Notiz

Konten Cash 13.162,00 USD

Stammdaten Konten

Konten Depots

Konten Sparpläne

Alle Buchungen

Berichte Vermögensaufstellung

Diagramm Bestand

Performance Berechnung

Berechnung Diagramm

Diagramm Rendite / Volatilität

Wertpapiere Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust)

Zahlungen 31,6

Trades

Klassifizierungen + Wertpapierart

Wertpapierart Industry Group

Allgemeine Daten Währungen

Währungen Einstellungen

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 10.175,00 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 8.818,00 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 *SPY - long - Uptr *SPY-Long-Call-Opt *SPX-Mini-Futures S&P 500 - buy & hol MES - long - Uptren MES - long - Uptren Test 1.3 - LURO shor Test 1.6 - LURO shor

Mi. 17. Juli 10:14:08

Seit 01.05.2024

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

Stammdaten

- Konten 25,65%
- Depots
- Sparpläne
- Alle Buchungen

Berichte

- Vermögensaufstellung 8,71%
- Diagramm
- Bestand

Performance

- Berechnung 24 Tage
- Diagramm
- Rendite / Volatilität
- Wertpapiere
- Zahlungen
- Trades

Klassifizierungen +

- Wertpapierart
- Industry Group

Allgemeine Daten

- Währungen
- Einstellungen

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

S&P 500

Berechnung

True Time-Weighted Rate of Return 12,93%

ca. Rendite 79,31% p.a.

Maximaler Drawdown 1,61%

Maximale Drawdown Dauer 15 Tage

Performance-Berechnung

Antfangswert (01.05.2024)	10.000,00
+ Kurserfolge	0,00
+ Realisierte Kurserfolge	2.570,00
+ Erträge	0,00
- Gebühren	5,00
- Steuern	0,00
+ Cash Fremdwährungsgewinne	0,00
+ Performanceneutrale Bewegungen	0,00
= Endwert (17.07.2024)	12.565,00

Monatsrenditen in einer Heatmap

J F M A M J J A S O N D

24 0,9 176 5,9

Jahresrenditen 24 25,7

Gesamtportfolio 25,7

aktuell nicht investiert und somit 100 % in Cash

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

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

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

Fr. 12. Juli 10:39:08

Wertpapiere + Konten

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	12.565,00	USD	

Cash

Umsätze Kontosaldenverlauf

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 müssen muss.

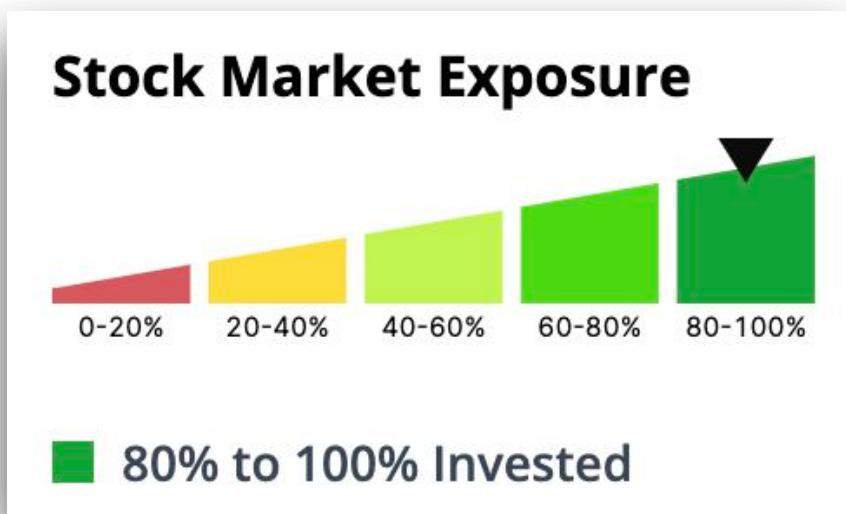
Im Gegenzug ist es einfacher und mit weniger Risiko verbunden, wenn man einen Aufwärtstrend im Gesamtmarkt für den Kauf einzelner Aktien nutzt (Rückenwind).

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- 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! 👈