

US-Markets - The Big Picture & Strategies

Donnerstag, 25. Juli 2024

Red-Nose-Day an der Wall Street - alle Indices holten sich gestern blutige Nasen und schlossen mit soliden bis kräftigen Verlusten den Tag ab. Am härtesten traf es wieder den Technologie-Sektor, allen voran die MAG 7.

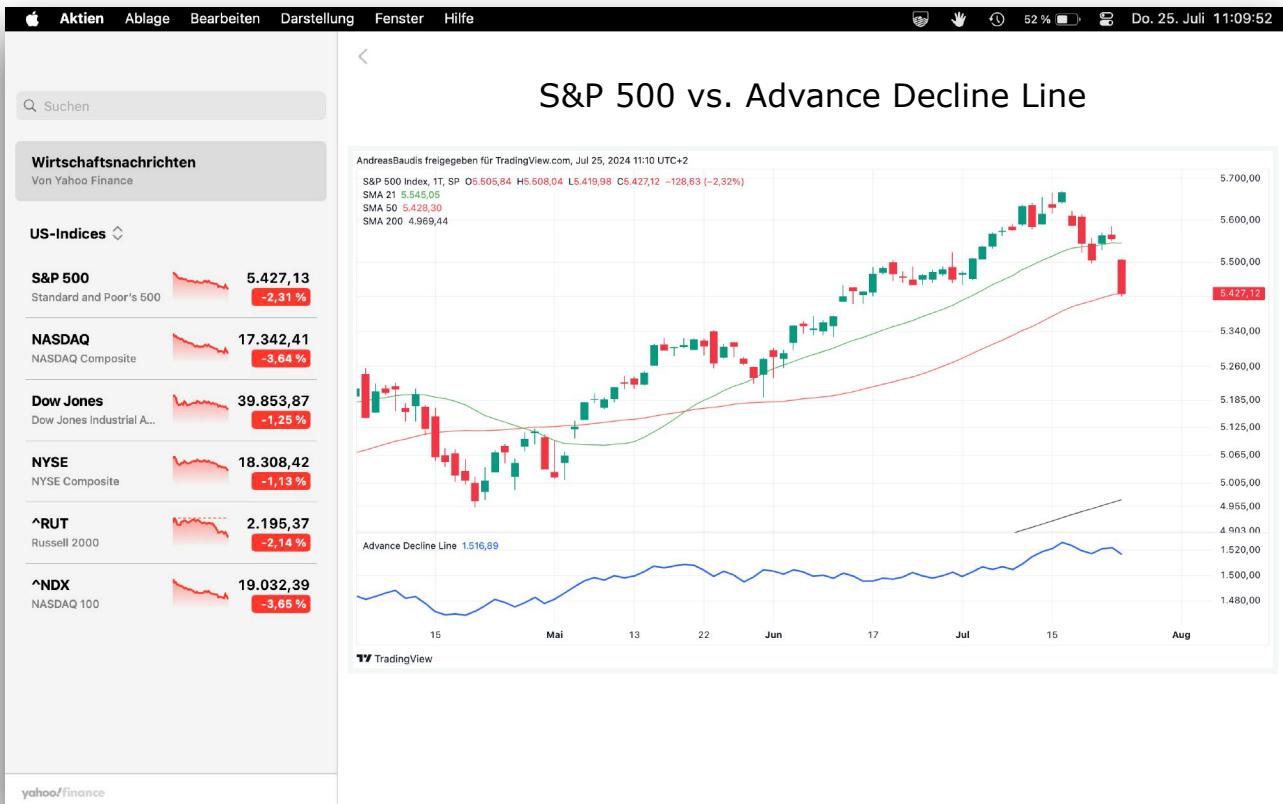
Der Handelsumsatz war an der Nasdaq und an der NYSE deutlich höher gegenüber dem Vortag und an beiden Börsen auch höher gegenüber dem Durchschnitt. In Verbindung mit den Verlusten fingen sich alle Indices einen sehr deutlichen D-Day ein.

Das Verhältnis von Aktien mit neuem Hoch zu Aktien mit neuem Tief beträgt dennoch 1,6 zu 1. Das Verhältnis von Aktien mit einem Kursgewinn zu Aktien mit einem Kursverlust beträgt dagegen etwa 1 zu 4,5 (Quelle beides: finviz.com).

Der SPX hat gestern, wenn auch knapp, den SMA 50 unterschritten. NDQ und NDX unterschritten den SMA 50 sehr deutlich, während der DJIA nur kurz mit dem SMA 50 geflirtet hat, aber noch knapp darüber liegt. Die Technologie-Indices NDQ und NDX, die normalerweise kräftige Aufwärtstrends anführen, führen jetzt die Verliererseite an - kein gutes Zeichen.

Der Gesamtmarkt bleibt unter Verkaufsdruck und könnte heute in die Korrektur übergehen, sofern der DJIA unter dem SMA 50 schließt und SPX und NDQ weiter unter dem SAM 50 bleiben. Eine ordentliche Portion Cash im Konto sollte im Moment als guter Stoßdämpfer dienen.

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



Wichtige Termine USA heute:

25. Juli 2024			
Bruttoinlandsprodukt q/q			
14:30	Aktuell	3.2%	1.4%
Auftragseingänge für langlebige Güter m/m			
14:30	Aktuell	-0.6%	0.1%
Kern, Auftragseingänge langlebiger Güter m/m			
14:30	Aktuell	0.3%	-0.1%
Erstanträge auf Arbeitslosenhilfe			
14:30	Aktuell	247 K	243 K

Die wichtigsten Quartalsergebnisse der Woche.

EARNINGS WHISPERS		Most Anticipated Earnings Releases for the week beginning July 22, 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
VZ	CLF	SPOT	TSLA	VRT	CMG	AAL	DXCM	BMV	
verizon	CLIFFS	Spotify	TESLA	VERTIV	CHIPOTLE MEXICAN GRILL	American Airlines	Dexcom	Bristol Myers Squibb	
ITC	NUE	UPS	GOOGL	Alphabet	AT&T	Ford	SKECHERS	3M	
TRUIST	NUCOR	GE	ENPH	ENPHASE	Amphenol	servicenow	HON	Charter Communications	
IQVIA	NXP	GE Aerospace	GM	VISA	Lamb Weston	IBM	Hasbro	Booz Allen Hamilton	
Kaspi.kz	SAP	gm	KO	Texas Instruments	Thermo Fisher Scientific	VIKING INVESTIGATIONS	Honeywell	SAIA	
DYNEX CAPITAL INC.	MEDPACE	Coca-Cola	FCX	SEAGATE	Tenet Health	LVS LAS VEGAS SANDS CORP.	RTX	CENTENE Corporation	
JH Bank of Hawaii	CROWN	FREIGHT McMILLAN COPPER & GOL	LMT	CHUBB	GE VERNONA	Newmont	RTX	Portland General Electric	
HBT Financial	CONS	LOCKHEED MARTIN	CMCSA	STX	GENERAL DYNAMICS	Whirlpool	Southwest	COLGATE-PALMOLIVE	
AGNC	cadence	AGNC	COMCAST	SEAGATE	Boston Scientific	WMI WASTE MANAGEMENT	lendingtree	BARNES	
ALEXANDRIA	ZION	AGNC	COF	CapitalOne	Cal-Maine Foods, Inc.	CLS	KDP	TRowePrice	
ZIONS BANCORPORATION	http://eps.sh/cal	POLARIS	CALM	PCA	PROJ	Celestica	DOC		
		PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PM	Cal-Maine Foods, Inc.	BSK	WHR	Keurig Dr Pepper		
						WM	AstraZeneca		
						WMI	Valero		

© 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.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

Willkommen IBKR LB.xml *SPY - long - Uptrend - Filt X SPY-Long-Call-Options@U SPX-Mini-Futures@Uptrend S&P 500 - buy & hold seit 0 MES - long - Uptrend - Filter MES - long - Uptrend - Filter

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

	SPY-ETF-Strategie	S&P 500	Berechnung
True Time-Weighted Rate of Return	133,98%	True Time-Weighted Rate of Return	Performance-Berechnung
Konten	92,32%	ca. Rendite	Anfangswert (01.02.2018) 10.000,00
Depots	ca. 14,01% p.a.	Maximaler Drawdown	+ Kurserfolge 0,00
Sparpläne	10,62% p.a.	Maximale Drawdown Dauer	+ Realisierte Kurserfolge 13.451,48
Alle Buchungen	5,08%	Maximaler Drawdown	+ Erträge 0,00
Berichte	265 Tage	Maximale Drawdown Dauer	- Gebühren 53,00
Vermögensaufstellung	Mittlere Haltedauer	746 Tage	- Steuern 0,00
Diagramm	27 Tage	Performance vs. S&P 500 (rot) auf Wochenbasis	+ Cash Fremdwährungsgewinne 0,00
Bestand	Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust)	Jahresrenditen	+ Performance neutrale Bewegungen 0,00
Performance	26 19 7	Gesamtporfolio	= Endwert (25.07.2024) 23.398,48
Berechnung	Trefferquote ca. 72 %		
Diagramm			
Rendite / Volatilität			
Wertpapiere			
Zahlungen			
Trades			
Klassifizierungen			
Wertpapierart			
Industry Group			
Allgemeine Daten			
Währungen			
Einstellungen			

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 - Uptr Test 1.3 - EURO s Test 1.6 - EURO s

Wertpapiere + **Konten** + **Suchen**

Konto	Kontostand	Währung	Notiz
Cash	23.398,48	USD	

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

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 shows the transaction history of the SPY-Long-Call-Option-Strategie. It includes several cash inflows (Einlagen) and option purchases (Kauf) for SPY options. The latest transaction listed is a cash inflow on 01.05.2024 at 17:41.

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	13.162,00	Big Picture Options Strategie
02.07.2024	Kauf	SPY240830C00553000	200	9,52	-1.905,00	1,00	10.175,00	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	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	9.670,00	Big Picture Options Strategie
15.05.2024	Kauf	SPY240719C00535000	100	8,52	-853,00	1,00	8.118,00	8.118,00	Big Picture Options Strategie
09.05.2024	Kauf	SPY240719C00525000	100	10,28	-1.029,00	1,00	8.971,00	8.971,00	Big Picture Options Strategie
01.05.2024	Einlage				10.000,00		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 - Uptrend - Filter *SPY-Long-Call-Options@U *SPX-Mini-Futures@Uptren X S&P 500 - buy & hold seit 0 MES - long - Uptrend - Filter MES - long - Uptrend - Filter Do, 25. Juli 11:14:36

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

Wertpapiere		SPX-Micro-Future-Strategie		S&P 500		Berechnung																						
Alle Wertpapiere				True Time-Weighted Rate of Return		Performance-Berechnung																						
		25,65%		8,14%		Anfangswert (01.05.2024) 10.000,00																						
Stammdaten		ca. Rendite		ca. Rendite		+ Kurserfolge 0,00																						
Konten		166,57% p.a.		40,53% p.a.		+ Realisierte Kurserfolge 2.570,00																						
Depots						+ Erträge 0,00																						
Sparpläne						- Gebühren 5,00																						
Alle Buchungen						- Steuern 0,00																						
Berichte						+ Cash Fremdwährungsgewinne 0,00																						
Vermögensaufstellung		Maximaler Drawdown		Maximaler Drawdown		+ Performanceneutrale Bewegungen 0,00																						
Diagramm		8,71%		4,24%		= Endwert (25.07.2024) 12.565,00																						
Bestand																												
Performance		15 Tage		15 Tage																								
Berechnung		Mittlere Haltedauer		Performance vs. S&P 500 (rot) auf Tagesbasis		Monatsrenditen in einer Heatmap																						
Diagramm		24 Tage				<table border="1"> <tr> <td>Mai 2024</td> <td>Juni 2024</td> <td>Juli 2024</td> <td>24</td> <td>0,9</td> <td>176</td> <td>5,9</td> </tr> <tr> <td colspan="3"></td> <td colspan="4">Jahresrenditen</td> </tr> <tr> <td colspan="3"></td> <td colspan="4">Gesamtportfolio 25,7</td> </tr> </table>		Mai 2024	Juni 2024	Juli 2024	24	0,9	176	5,9				Jahresrenditen							Gesamtportfolio 25,7			
Mai 2024	Juni 2024	Juli 2024	24	0,9	176	5,9																						
			Jahresrenditen																									
			Gesamtportfolio 25,7																									
Rendite / Volatilität		Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust)																										
Wertpapiere		2 ↑ 2 ↓ 0																										
Zahlungen		(je volle 5.000 USD = 1 MES-Kontrakt)																										
Trades																												
Klassifizierungen																												
Wertpapierart																												
Industry Group																												
Allgemeine Daten																												
Währungen																												
Einstellungen																												
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- *SPX-Mini-Future X S&P 500 - buy & MES - long - Uptr MES - long - Uptr Test 1.3 - LURO s Test 1.6 - LURO s Fr, 12. Juli 10:39:08

Wertpapiere + Konten ➤

Wertpapiere		Konten	
Alle Wertpapiere		Konto	Kontostand Währung Notiz
		Cash	12.565,00 USD

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

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! 🤘