

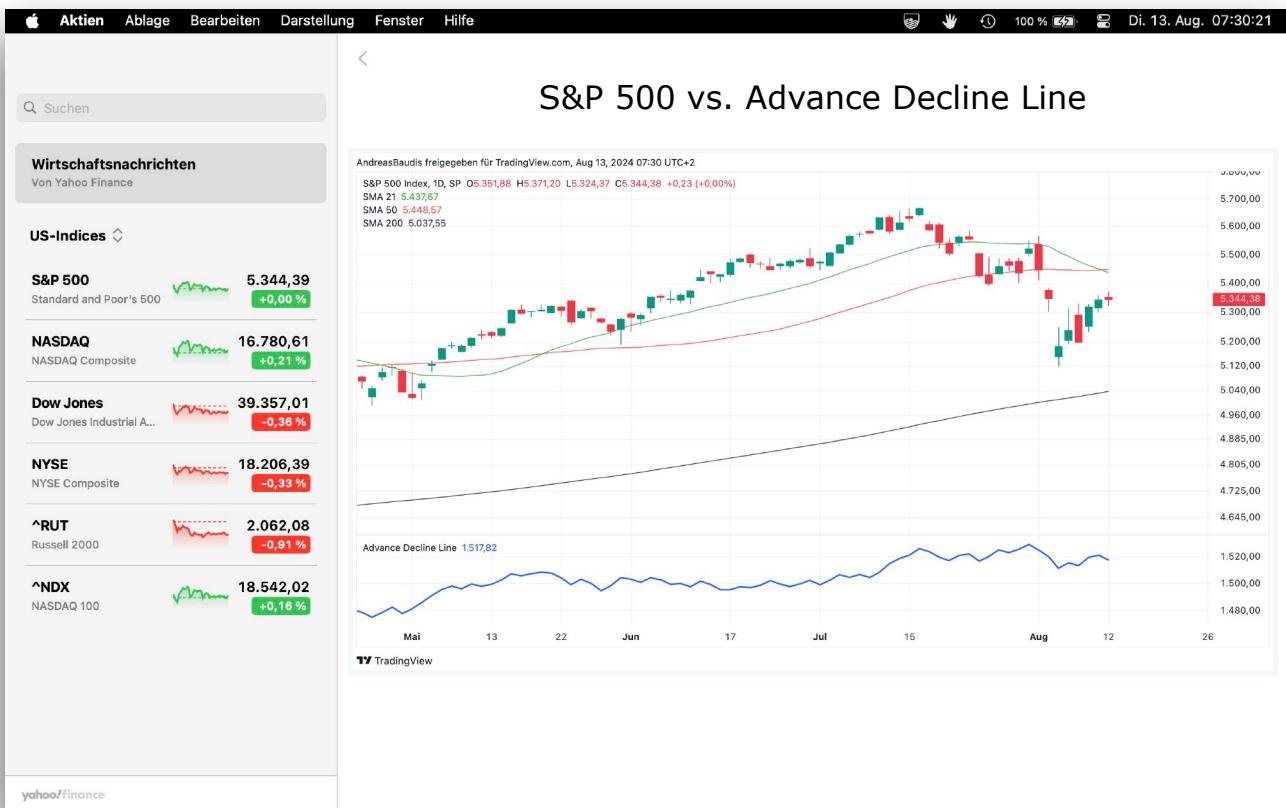
Keine klare Richtung gestern an der Wall Street und zur Schlußglocke verbleiben überwiegend leichte Gewinne bis leichte Verluste. Lediglich der RUT ging mit soliden Verlusten aus dem Handel.

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 1 zu 2,2. Das Verhältnis von Aktien mit einem Kursgewinn zu Aktien mit einem Kursverlust beträgt dagegen 1 zu 1,4 (Quelle beides: finviz.com).

Der Gesamt-Markt bleibt in der Korrektur, arbeitet aber an einer Aufwärtsbewegung. Cash ist nach wie vor ein guter Freund und beruhigt die Nerven. Wer mutig ist, baut erste kleine Pilot-Positionen auf.

Die Index-Strategien sind zu 100 % in Cash und warten auf die nächste Gelegenheit zum Einstieg. Erfahrungsgemäß sind die Monate August und September für den Einstieg der Index-Strategie nicht geeignet, so dass es eher bei Cash & Warten bleibt. Sollte sich der Markt jedoch von einer sehr starken Seite zeigen... we will see.



Wichtige Termine USA heute:

13. August 2024			
PPI m/m			
	-	0.1%	0.2%
14:30	Aktuell	Prognose	Vorherige

Die wichtigsten Quartalsergebnisse der Woche.

EARNINGS WHISPERS		Most Anticipated Earnings Releases for the week beginning August 12, 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
GOLD	WULF	ONON	NU	EAT	CSCO	BABA	AMAT	FLO	
BARICK	TERAWULF	MELCO	SURG	Brinker	CISCO	Alibaba Group	Applied Materials	Flowers Foods	
MNDY	RAIL	HD	SurgePays	CAH	ASTS	WMT	COHR	CINT	
monday.com	FREIGHTCAR AMERICA	MELCO	OUSTER	CardinalHealth	AST	Walmart	COHERENT	CIAST	
ESPR	ARQ	HD	GoldRoyalty	CAE	SpaceMobile	JD	AMCR	OCFT	
ESPERION	Arq	sea	ZEVRA	CAE	d-local	JD.COM	amcor	Flowers Foods	
BEKE	AGRO	HUT8	therapeutics	DOLE	Dole	DE	SIGMA	金融壹账通	
BALLARD	DOUBLE DOWN INTERACTIVE	Paysafe:	The Oncology Institute of Hope - Innovation	DOLE	stone	GRAB	H&R BLOCK		
ORLA	rumble	MindMed	intapp	ARCO	GEOPARK	Grab	DESG		
MINING	SLF	INTUITIVE MACHINES	ASIM	Arcos Dorados	GEOPARK	ReNew POWER	despegar		
YUCHAI	Sun Life	HYZN	AVINO	PSQR	dragonfly	ReNew POWER	RNW		
CEPU	DHT	HYZN	FNV	MediWound	LONGEVERON	alvotech	ALVO		
Central Puerto	PERSPECTIVE THERAPEUTICS	INTUITIVE MACHINES	FNV	UBS	CELL-BASED THERAPIES	gambling.com	GLOB		
ADAP	CCAP	HYZN	SVM	UBS	lulus	globant			
Adaptimmune	CRESCENT	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT	SILVERCORP METALS INC.	uCloudlink		Golar LNG			
BBGI	Crescent Capital BDC, Inc.	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT							
BEASLEY									
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.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

Willkommen *IBKR LB.xml *SPY - long - Uptrend - Filter 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% 89,38% Performance-Berechnung

ca. Rendite 13,89% p.a. 10,27% p.a. Anfangswert (01.02.2018) 10.000,00

Maximaler Drawdown 5,08% 33,92% + Kurserfolge 0,00

Maximale Drawdown Dauer 265 Tage 746 Tage + Realisierte Kurserfolge 13.451,48

Mittlere Haltedauer 27 Tage 746 Tage + Erträge 0,00

Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust) 26 ↑19 ↓7 150% - Gebühren 53,00

Trefferquote ca. 72 % 100% - Steuern 0,00

Jahresrenditen

Gesamtportfolio 3,6

2018 18

2019 19

2020 20

2021 21

2022 22

2023 23

2024 24

Performance vs. S&P 500 (rot) auf Wochenbasis

2018 2020 2022

150%

100%

50%

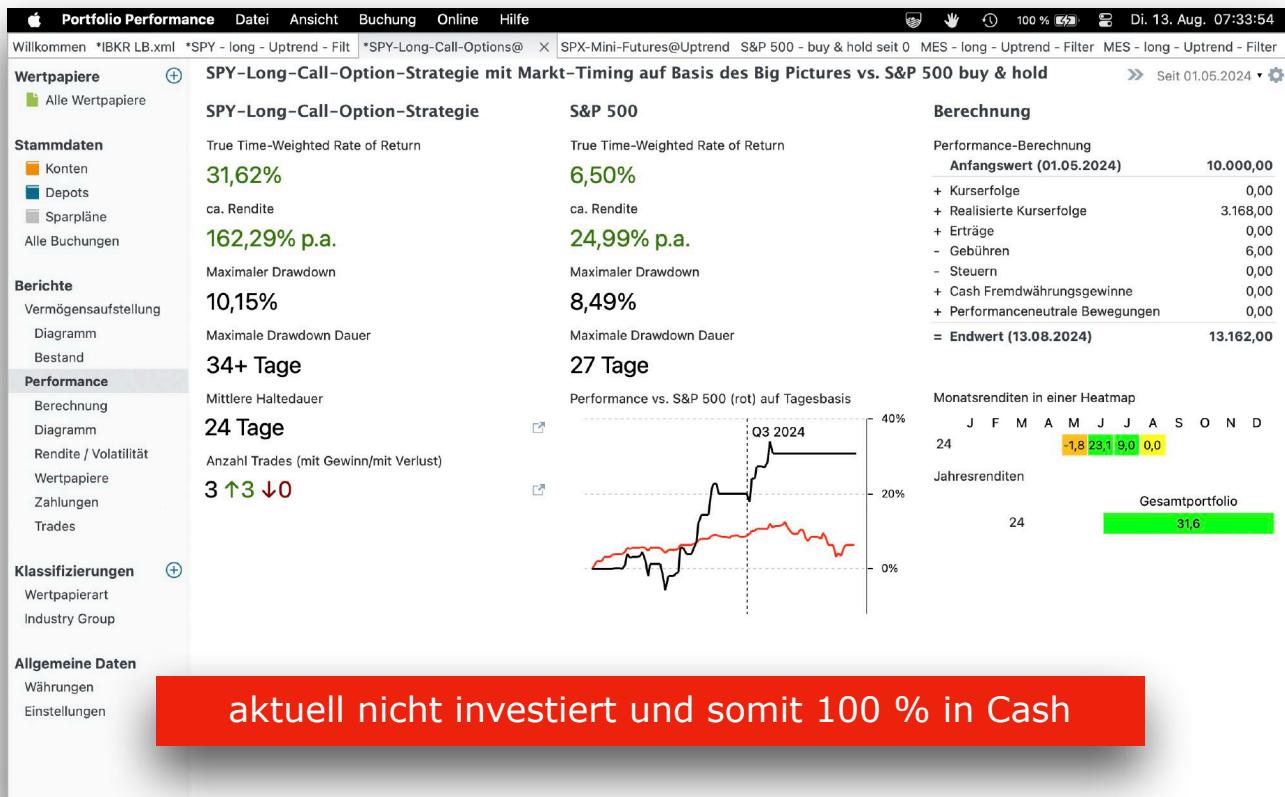
0%

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 - ei	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 - LURO s
Wertpapiere		Konten													+		+	
Stammdaten		Konto Kontostand Währung Notiz													+		+	
Konten		Cash	23.398,48	USD														
Depots																		
Sparpläne																		
Alle Buchungen																		
Berichte																		
Vermögensaufstellung		Cash													Suchen		+	
Diagramm		Umsätze Kontosaldenverlauf															+	
Bestand																	+	
Performance		Datum	Transaktion	Symbol	Stück	Orderkurs	Order-Betrag	Gebühren	Rest-Saldo	Cash	Strategie	Depot						
Berechnung		11.07.2024, 17:41	Verkauf	SPY	42	556,65	23.398,48	1,00	23.398,48		Big Picture	ETF Strategie						
Diagramm		02.07.2024	Kauf	SPY	42	549,01	-23.079,32	1,00	0,00		Big Picture	ETF Strategie						
Rendite / Volatilität		20.06.2024, 18:30	Verkauf	SPY	42,2	546,50	23.079,32	1,00	23.079,32		Big Picture	ETF Strategie						
Wertpapiere		15.05.2024	Kauf	SPY	20,9	529,78	-11.085,70	1,00	0,00		Big Picture	ETF Strategie						
Zahlungen		09.05.2024	Kauf	SPY	21,3	520,17	-11.085,69	1,00	11.085,70		Big Picture	ETF Strategie						
Trades		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						
Klassifizierungen	+	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						
Wertpapierart		16.06.2023	Verkauf	SPY	43,5	439,46	19.130,25	1,00	19.130,25		Big Picture	ETF Strategie						
Industry Group		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						
Allgemeine Daten		25.04.2023	Verkauf	SPY	45	406,08	18.273,94	1,00	18.273,94		Big Picture	ETF Strategie						
Währungen		29.03.2023	Kauf	SPY	45	401,35	-18.063,07	1,00	0,00		Big Picture	ETF Strategie						
Einstellungen		29.07.2022	Verkauf	SPY	43,8	341,99	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						
		06.11.2021	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.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

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

Fr. 12. Juli 10:27:11

Wertpapiere + **Konten**

Konto Kontostand Währung Notiz

- Cash 13.162,00 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	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	10,175,00	Big Picture Options Strategie
02.07.2024	Kauf	SPY240830C00553000	200	9,52	-1.905,00	1,00	10,175,00	12.080,00	Big Picture Options Strategie
20.06.2024, 18:30	Verkauf	SPY240719C00525000	100	24,11	2.410,00	1,00	12.080,00	9,670,00	Big Picture Options Strategie
20.06.2024, 18:30	Verkauf	SPY240719C00535000	100	15,53	1.552,00	1,00	9,670,00	8.118,00	Big Picture Options Strategie
15.05.2024	Kauf	SPY240719C00535000	100	8,52	-853,00	1,00	8.118,00	8.971,00	Big Picture Options Strategie
09.05.2024	Kauf	SPY240719C00525000	100	10,28	-1.029,00	1,00	8.971,00	10.000,00	Big Picture Options Strategie
01.05.2024	Einlage						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@ *SPX-Mini-Futures@Uptren X S&P 500 - buy & hold seit 0 MES - long - Uptrend - Filter MES - long - Uptrend - Filter

Di. 13. Aug. 07:34:25

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

True Time-Weighted Rate of Return **25,65%**

ca. Rendite **122,85% p.a.**

Maximaler Drawdown **8,71%**

Maximale Drawdown Dauer **34+ Tage**

Mittlere Haltedauer **24 Tage**

Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust) **2 ↑ 2 ↓ 0**

(je volle 5.000 USD = 1 MES-Kontrakt)

S&P 500

True Time-Weighted Rate of Return **6,50%**

ca. Rendite **24,99% p.a.**

Maximaler Drawdown **8,49%**

Maximale Drawdown Dauer **27 Tage**

Berechnung

Performance-Berechnung

Anfangswert (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 (13.08.2024) **12.565,00**

Performance

Monatsrenditen in einer Heatmap

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

24 0,9 176 5,9 0,0

Jahresrenditen

Gesamtportfolio **25,7**

Klassifizierungen +

Allgemeine Daten

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

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

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 10.000,00

Klassifizierungen +

Wertpapierart

Industry Group

Allgemeine Daten

Währungen

Einstellungen

*** 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.

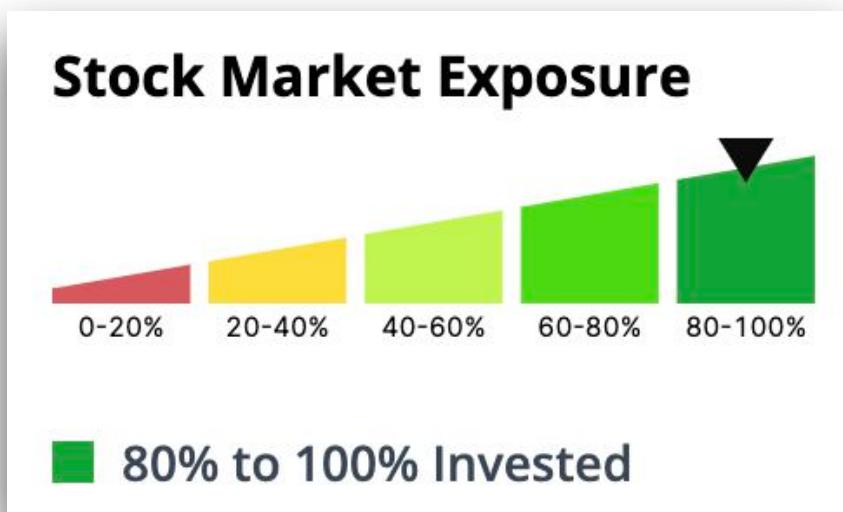
Im Gegenzug ist es einfacher und mit weniger Risiko verbunden, wenn man einen Aufwärtstrend im Gesamtmarkt für den Kauf einzelner Aktien nutzt (Rückenwind).

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! 👈