

US-Markets - The Big Picture & Strategies

Mittwoch, 14. August 2024

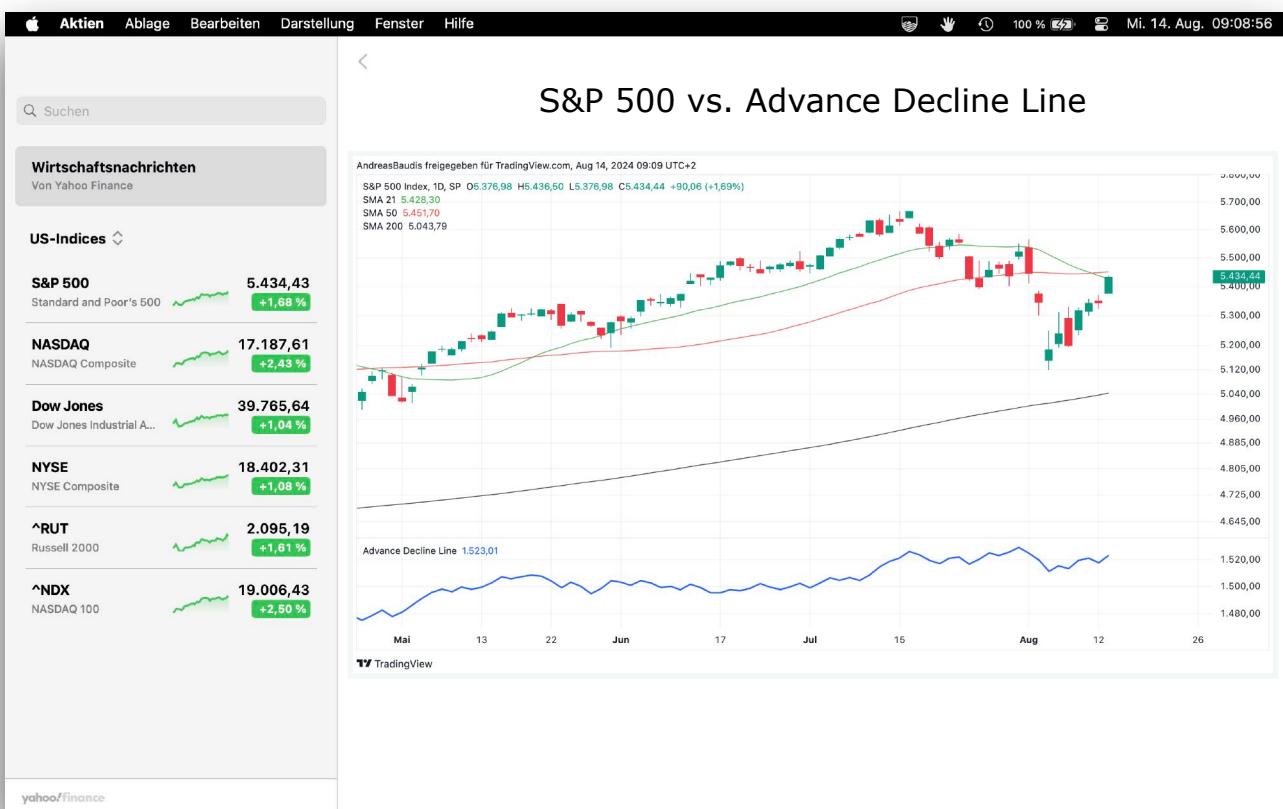
Die Wall Street wurde gestern durch günstige Inflationsdaten sowie Aussagen eines hochrangigen FED-Vertreters zu möglichen Zinssenkungen ordentlich befeuert, so dass die Indices solide bis kräftig zulegen konnten, allen voran wieder der Technologie-Sektor.

Der Handelsumsatz war an beiden Hauptbörsen höher gegenüber dem Vortage, blieb jedoch unter dem Durchschnitt.

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

Der gestrige Handelstag bescherte dem SPX und dem NDQ einen FTD, so dass sich der Gesamtmarkt nun wieder im bestätigten Aufwärtstrend befindet. Aber Achtung: der Trend sollte nun in den kommenden Tagen mit weiter steigenden Kursen gefestigt werden. Das gestrige Tief sollten die drei Hauptindices SPX, NDQ und DJIA nicht unterschreiten, da dies in 90 % aller Fälle zum Abwürgen des Aufwärtstrends führt. Auch liegen noch wichtige Key-Levels vor SPX und NDQ, die es nachhaltig zu überwinden gilt: SMA 21 und SMA 50. Der DJIA sieht im Moment etwas besser aus - er hat den SMA 50 bereits hinter sich gelassen und nun noch den 21er SMA vor sich. Ein weiterer Punkt, der zu vorsichtigem Handeln mahnt: die technologielastigen Indices NDQ und NDX laufen auf Basis der relativen Stärke auf 50 Handelstage den anderen Indices hinterher. In einem starken Aufwärtstrend sollten NDQ und NDX den Gesamtmarkt eher anführen.

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:

14. August 2024			
CPI m/m			
14:30	Aktuell	0.1%	-0.1%
		Prognose	Vorherige
Kern-CPI m/m			
14:30	Aktuell	0.2%	0.1%
		Prognose	Vorherige
EIA Rohöl, Änderung der Speichermenge			
16:30	Aktuell	-5.514 M	-3.728 M
		Prognose	Vorherige
EIA Rohöl, Änderung der Speichermengen in C...			
16:30	Aktuell	-0.124 M	0.579 M
		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	
GOLD	WULF			ONON	NU	EAT	CSCO	BABA	AMAT	FLO	
BARICK	TERAWULF			MELCO	SURG	Brinker INTERNATIONAL	ASTS	Alibaba Group	APPLIED MATERIALS	Flowers FOODS	
MNDY	RAIL			HD	SurgePays	CAH	AST	WMT	COHR	CINT	
monday.com	FREIGHTCAR AMERICA			THE HUT GROUP	OUSTER	CardinalHealth	SpaceMobile	JD.COM	COHERENT	amcor	
ESPR	ARQ			sea	GoldRoyalty	CAE	d-local	JD.COM	AMCR	SIGMA LITHIUM	
ESPERION	BEKE			HUT8	ZEVRA THERAPEUTICS	DOLE	stone+	JOHN DEERE	H&R BLOCK	RNW	
贝壳	BLDP			Paysafe:	The Oncology Institute of Hope - Innovation	Dole	GEOPARK	ReNew POWER	despegar	ALVO	
BALLARD	DOUBLE DOWN INTERACTIVE			MindMed	intapp	PFPG Performance Food Group	dragonfly	gambling.com	globant	GLOB	
ORLA MINING	rumble			INTUITIVE MACHINES	AVINO	ARCO	LONGEVERON	GAMB	alvotech		
VUCHAI	Sun Life			HYZON	FNC	Arcos Dorados	CELL-BASED THERAPIES	SOWG			
CEPU	DHT DATA			TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT	SVM	PSQR	LVLU	GLNG			
Central Puerto	PERSPECTIVE THERAPEUTICS				SILVERCORP METALS INC.	MediWound	UCL	Golar LNG			
ADAP	CRESCENT					UBS	uCloudlink				
Adaptimmune	Crescent Capital BDC, Inc.					UBS	lulus				
BIGI						UCL					
BEASLEY											
Media Group, LLC											
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 - Filt X SPY-Long-Call-Options@U SPX-Mini-Futures@U 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%	92,58%	Performance-Berechnung																																																		
ca. Rendite	13,89% p.a.	10,55% 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					+ Erträge 0,00	Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust)	26 ↑19 ↓7					- Gebühren 53,00	Trefferquote ca. 72 %						- Steuern 0,00				+ Cash Fremdwährungsgewinne 0,00				+ Performance neutrale Bewegungen 0,00				= Endwert (14.08.2024) 23.398,48
			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					+ Erträge 0,00	Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust)	26 ↑19 ↓7					- Gebühren 53,00	Trefferquote ca. 72 %						- Steuern 0,00				+ Cash Fremdwährungsgewinne 0,00				+ Performance neutrale Bewegungen 0,00				= Endwert (14.08.2024) 23.398,48							
			+ Kurserfolge 0,00																																																		
Maximale Drawdown Dauer	265 Tage	746 Tage				+ Realisierte Kurserfolge 13.451,48	Mittlere Haltedauer	27 Tage					+ Erträge 0,00	Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust)	26 ↑19 ↓7					- Gebühren 53,00	Trefferquote ca. 72 %						- Steuern 0,00				+ Cash Fremdwährungsgewinne 0,00				+ Performance neutrale Bewegungen 0,00				= Endwert (14.08.2024) 23.398,48														
			+ Realisierte Kurserfolge 13.451,48																																																		
Mittlere Haltedauer	27 Tage					+ Erträge 0,00	Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust)	26 ↑19 ↓7					- Gebühren 53,00	Trefferquote ca. 72 %						- Steuern 0,00				+ Cash Fremdwährungsgewinne 0,00				+ Performance neutrale Bewegungen 0,00				= Endwert (14.08.2024) 23.398,48																					
			+ Erträge 0,00																																																		
Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust)	26 ↑19 ↓7					- Gebühren 53,00	Trefferquote ca. 72 %						- Steuern 0,00				+ Cash Fremdwährungsgewinne 0,00				+ Performance neutrale Bewegungen 0,00				= Endwert (14.08.2024) 23.398,48																												
			- Gebühren 53,00																																																		
Trefferquote ca. 72 %						- Steuern 0,00				+ Cash Fremdwährungsgewinne 0,00				+ Performance neutrale Bewegungen 0,00				= Endwert (14.08.2024) 23.398,48																																			
			- Steuern 0,00																																																		
			+ Cash Fremdwährungsgewinne 0,00																																																		
			+ Performance neutrale Bewegungen 0,00																																																		
			= Endwert (14.08.2024) 23.398,48																																																		

Klassifizierungen +

Allgemeine Daten

aktuell nicht investiert und somit 100 % in Cash

Jahresrenditen

Gesamtporfolio

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 & hold MES - long - Uptr MES - long - Uptr Test 1.3 - EURO s Test 1.6 - EURO s

Wertpapiere + **Konten**

Konto	Kontostand	Währung	Notiz
Cash	23.398,48	USD	

Stammdaten

- Konten
- Depots
- Sparpläne

Berichte

Vermögensaufstellung Diagramm Bestand

Performance Berechnung Diagramm Rendite / Volatilität Wertpapiere Zahlungen Trades

Klassifizierungen +

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.

Wertpapiere	Konten
Stammdaten	Konto Kontostand Währung Notiz
Konten	Cash 13.162,00 USD
Berichte	
Performance	
Klassifizierungen	
Allgemeine Daten	

Cash

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	8.118,00		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 *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 Mi. 14. Aug. 09:14:18

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 25,65%
- Depots
- Sparpläne
- Alle Buchungen

Berichte

- Vermögensaufstellung 8,71%
- Diagramm
- Bestand

Performance

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

Klassifizierungen + Wertpapierart

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

True Time-Weighted Rate of Return 8,29%

ca. Rendite 32,25% p.a.

Maximaler Drawdown 8,49%

Maximale Drawdown Dauer 28 Tage

Mittlere Haltedauer 24 Tage

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

(je volle 5.000 USD = 1 MES-Kontrakt)

Berechnung

Performance-Berechnung

Aufgangswert (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 (14.08.2024)	12.565,00

Monatsrenditen in einer Heatmap

J F M A M J J A S O N D
24 0,9 17,6 5,9 0,0

Jahresrenditen

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-*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

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	12.565,00	USD	

Cash

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! 🤘