

Zum Auftakt des neuen Börsenmonats gestern marktweit kräftige Verluste an der Wall Street. Der Technologie-Sektor wurde dabei am Härtesten getroffen.

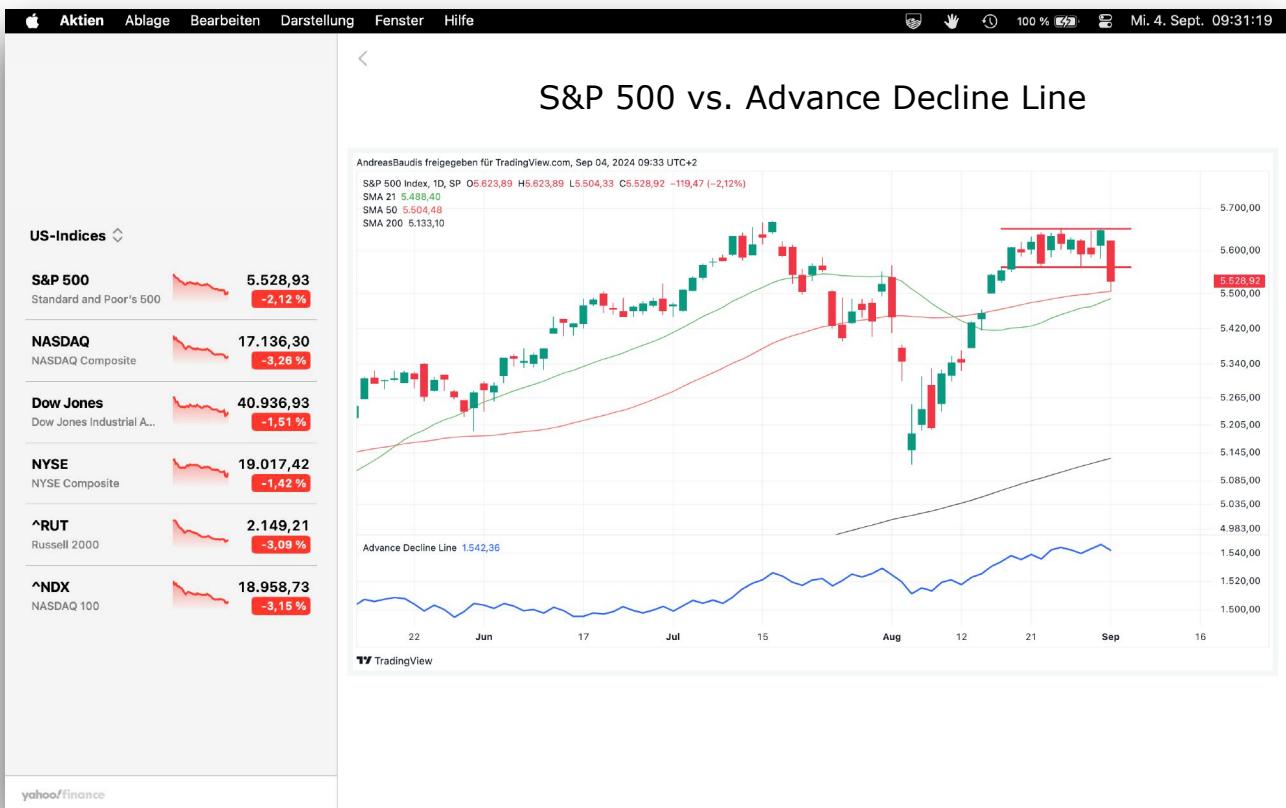
Der Handelsumsatz war an der Nasdaq höher gegenüber dem Vortag und auch dem Durchschnitt. An der NYSE dagegen geringer gegenüber dem Vortag aber höher gegenüber dem Durchschnitt.

Das Verhältnis von Aktien mit neuem 52-Wochen-Hoch zu Aktien mit neuem 52-Wochen-Tief beträgt dennoch 1,7 zu 1. Das Verhältnis von Aktien mit einem Kursgewinn zu Aktien mit einem Kursverlust beträgt dagegen 1 zu 4,5. (Quelle beides: finviz.com).

Der SPX hat im Tagesverlauf schon einmal mit dem SMA 50 geflirtet und dabei auch gleich die Seitwärtsbewegung nach unten durchbrochen. NDQ und NDX liegen nun deutlich unter den Key-SMA's von 21 und 50 Tagen. Ein Blick auf die Tagescharts der MAG 7 verheißt auch nichts Gutes: kurzfristig leicht bis deutlich sichtbare Abwärtstendenzen erkennbar.

Der Gesamtmarkt bleibt im Aufwärtstrend, zeigt aber deutlich Schwäche. Positionen zu reduzieren und das Pulver trocken zu halten, kann jetzt nicht schaden.

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:

4. September 2024			
Handelsbilanz			
 14:30	– Aktuell	\$-73.063 B	\$-73.109 B
Auftragseingänge der Hersteller m/m			
 16:00	– Aktuell	-0.3%	-3.3%
JOLTS Stellenangebote			
 16:00	– Aktuell	7.876 M	8.184 M
Fed Beige Book			
 20:00	– Aktuell	– Prognose	– Vorherige

Die wichtigsten Quartalsergebnisse der Woche.

EARNINGS WHISPERS		Most Anticipated Earnings Releases for the week beginning September 02, 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
		 MOMO 攀文集团	 ZS zscaler	 DKS DICK'S SPORTING GOODS	 AI C3.ai	 NIO	 BROADCOM	 BIG LOTS	
		 GitLab	 ASAN asana	 DOLLAR TREE	 HPE Hewlett Packard Enterprise	 TORO	 UiPath	 ABM	
		 HealthEquity	 Hormel Foods	 ciena	 Casey's	 SAIC	 samsara	 BRADY	
		 SPORTSMAN'S WAREHOUSE	 CORE & MAIN	 sprinklr	 LANDS' END	 KORN FERRY	 Quanex building products		
		 onestream	 AMERICA'S CAR-MART	 Copart	 ZUMIEZ				
		 ascendis pharma	 TORRID SIZES 10 TO 30	 VERINT.	 SHOE CARNIVAL	 MOVADO GROUP INC	 smartsheet		
		 PagerDuty	 JILL KNOP	 AeroVironment	 MOVADO GROUP INC	 TILLYS			
			 KNOT Offshore Partners LP	 CONCRETE PUMPING HOLDINGS					
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 - 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 Fr. 12. Juli 10:15:49

Wertpapiere + Konten

Konto Kontostand Währung Notiz

Stammdaten

Konten

Cash 23.398,48 USD

Berichte

Vermögensaufstellung Diagramm Bestand

Performance Berechnung Diagramm Rendite / Volatilität Wertpapiere Zahlungen Trades

Klassifizierungen + 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.

Wertpapiere: Konten

Stammdaten: Konten

Berichte: Vermögensaufstellung

Performance: Berechnung

Klassifizierungen: Wertpapierart, Industry Group

Allgemeine Daten: Währungen, Einstellungen

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	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		

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

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% 10,17% Berechnung Performance-Berechnung

ca. Rendite 93,76% p.a. 32,70% p.a. Anfangswert (01.05.2024) 10.000,00

Alle Buchungen Maximaler Drawdown 8,71% 8,49% + Kurserfolge 0,00

Berichte Vermögensaufstellung 56+ Tage 49 Tage + Realisierte Kurserfolge 2.570,00

Maximale Drawdown Dauer 24 Tage Performance vs. S&P 500 (rot) auf Tagesbasis

Diagramm Bestand 24 0,9 176 5,9 0,0 0,0

Maximale Drawdown Dauer 24 Jahresrenditen

Bestand 24 25,7 Gesamtportfolio

Performance Berechnung 24

Diagramm 24

Rendite / Volatilität Wertpapiere Zahlungen Trades

Zahlungen 2 2 0 (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

Wertpapiere + Konten

Stammdaten Konten

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 bzw. Erläuterungen:

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

Aufwärtstrend-Tag: ein Tag mit Tagesgewinn oder höherem Hoch und höherem Tief

*** 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! 👈