

US-Markets - The Big Picture & Strategies

Montag, 14. Oktober 2024

Zum Wochenausklang am Freitag legten die Indices leicht bis kräftig zu. Der RUT führte den Markt mit + 2,10 % an, während der NDX mit + 0,15 % den anderen Indices hinterher lief. SPX, DJIA und NYA erreichten dabei neue ATHs.

Der Handelsumsatz war an beiden Börsen geringer gegenüber Vortag und Durchschnitt.



(Quelle: [finviz.com](#))

Auf Wochenbasis legten die Indices bei rückläufigem Umsatz leicht zu.

Der Gesamt-Markt ist weiter im Aufwärtstrend.

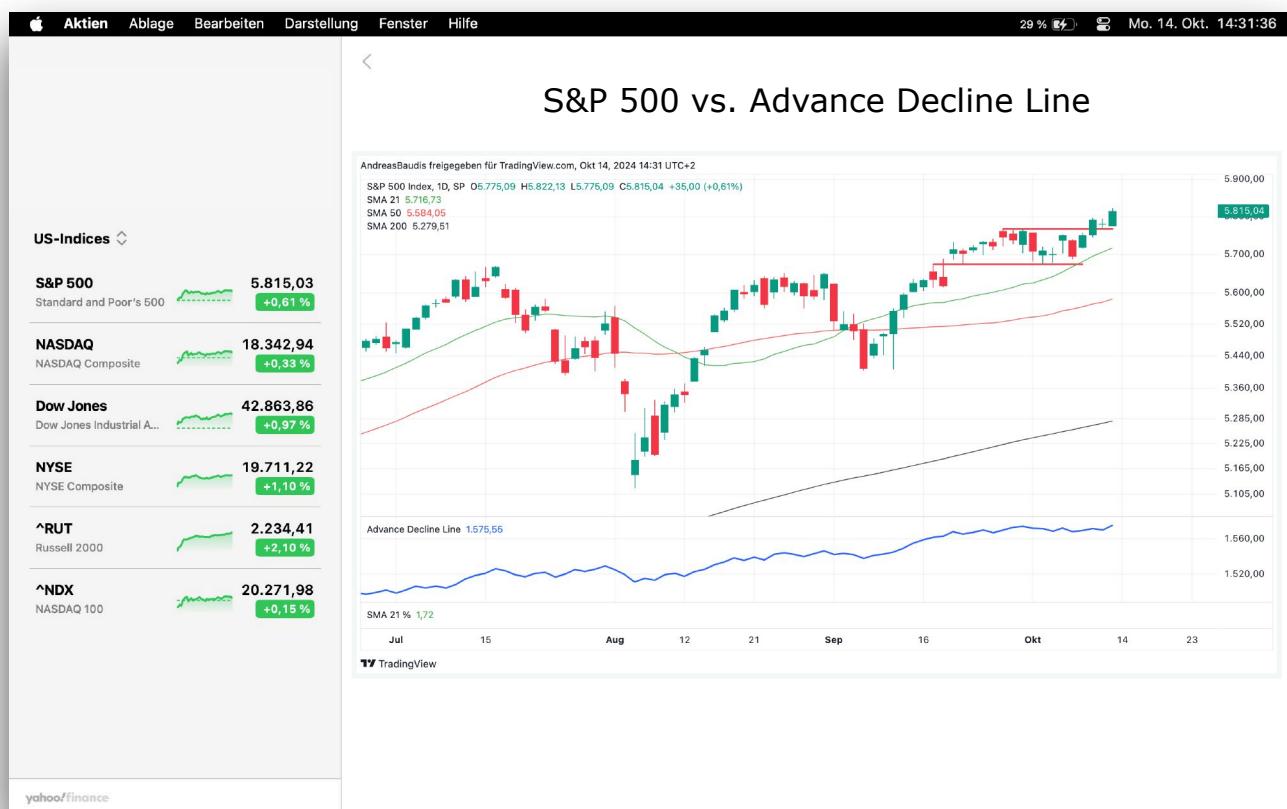
Ausblick: der Aufwärtstrend setzt sich weiter zäh fort - mehr Umsatz wäre gut

Bedingungs-Order für die Index-Strategien:

TakeProfit bei einem SPX-Kurs von: 6.094 (fix)

StopLoss bei einem SPX-Kurs von: 5.573,50 (Notstopp, wird täglich und ausschließlich nach oben nachgezogen)

Die SPX-Future-Strategie wurde gegen eine LURO-Aktien-Strategie getauscht.



Wichtige Termine USA heute:

14. Oktober 2024			
Kolumbus-Tag			
	-	-	-
Den ganze...	Aktuell	Prognose	Vorherige
Fed Präsident Waller spricht			
	-	-	-
21:00	Aktuell	Prognose	Vorherige

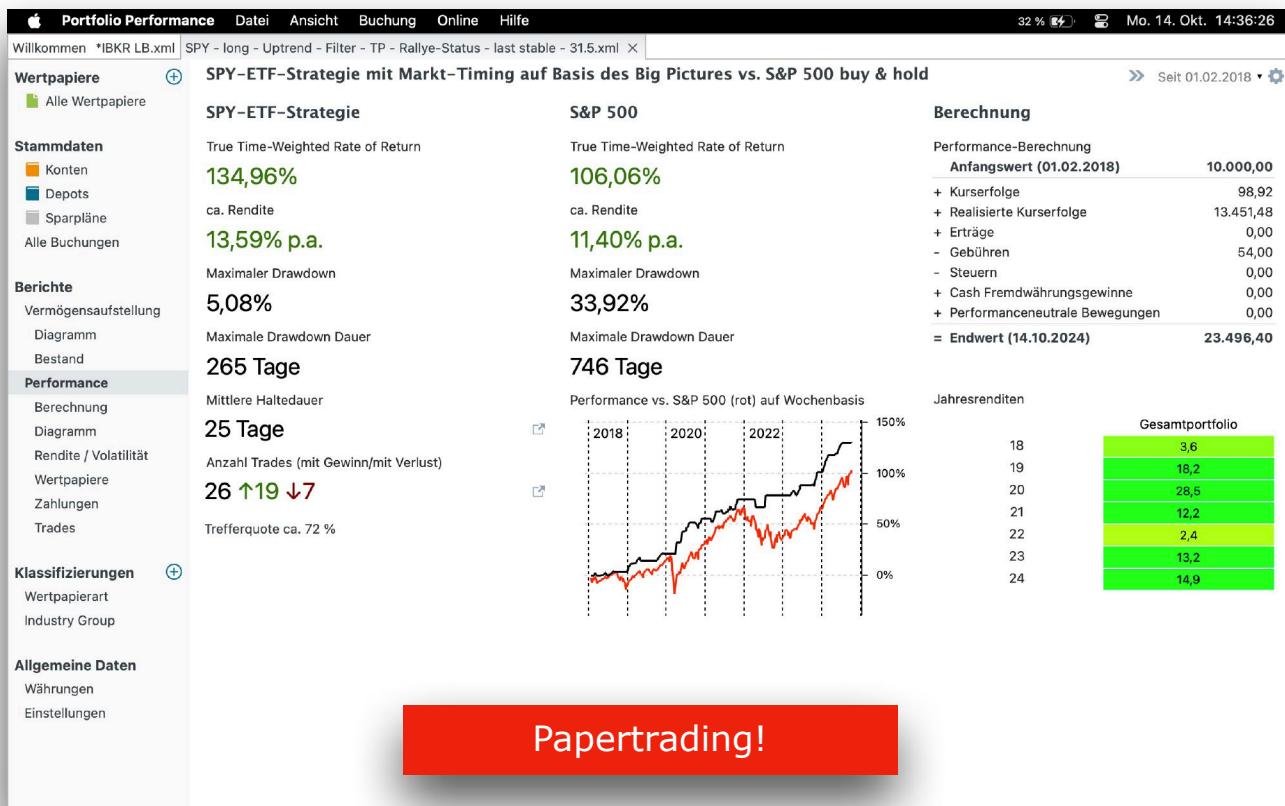
Die wichtigsten Quartalsergebnisse der Woche.

EARNINGS WHISPERS		Most Anticipated Earnings Releases for the week beginning October 14, 2024									
		Monday		Tuesday		Wednesday		Thursday		Friday	
		Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	
KARO	KAROOOO			WBA	UAL	ASML	AA	TSM	NFLX	CMA	
				Walgreens Boots Alliance	United	Morgan Stanley	Alcoa	tsmc	NETFLIX	ComenA	
UNH	UNITEDHEALTH GROUP			IBKR	Interactive Brokers	ABT	Rexford Industrial	TRV	ISRG	SLB	
C	CITI			J.B. HUNT	SGH	Abbott	KINDER MORGAN	Travelers	INTUITIVE SURGICAL™	AMERICAN EXPRESS	
BAC	BANK OF AMERICA			PNEF	Pinnacle	usbancorp	PPG	HBAN	WD-40 COMPANY	PG	
JNJ	Johnson & Johnson			EPAC	ENERPAC TOOL GROUP	Citizens Financial Group, Inc.	CSX	ELV	CROWN	ALV	
PGR	PROGRESSIVE			EPAC	EQUIPAC TOOL GROUP	FIRST HORIZON NATIONAL CORPORATION	STLD	INFY	Western Alliance Bank	RF	
SCHW	charles SCHWAB			EQBK	EQUITY BANCSHARES, INC.	SYF	Steel Dynamics, Inc.	TCBI	First National Bank	REGIONS	
GS	Goldman Sachs			OMC	OmnicomGroup	FCCO	First Community Corporation	TXCAP	MARTEN	FIFTH THIRD BANK	
PNC	PNC			FULT	FULTON FINANCIAL CORPORATION	PLD	PROLOGIS	MTB	M&T Bank	ALLY	
STT	STATE STREET					OFG	OFG Bancorp	INSTEEL	Metropolitan Commercial Bank	SFNC	
							DISCOVER	CMC	ALPINE	Simmons Bank	
							EQUIFAX	OCFC	OCEANFIRST BANK	ACU	
										Acme United Corporation	

<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.

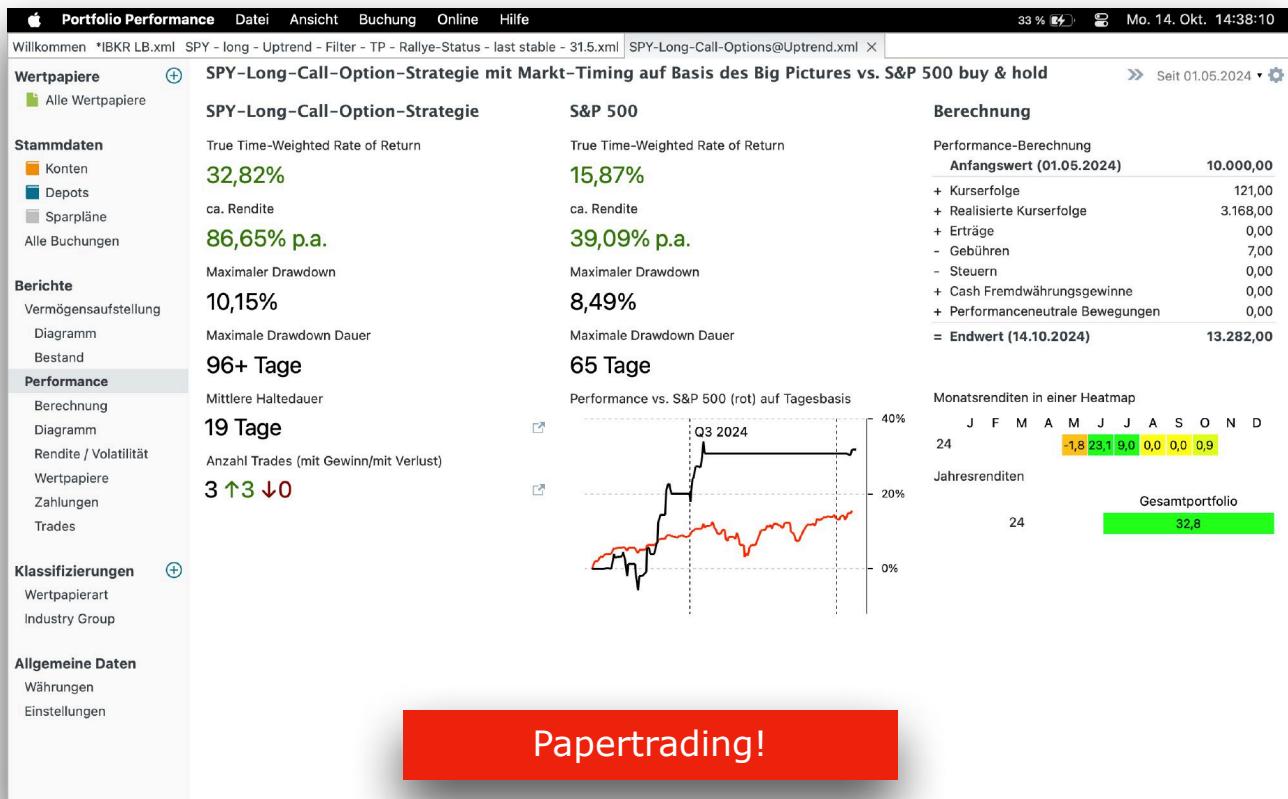


Die letzten Transaktionen der SPY-ETF-Strategie.

The transaction history table displays the following data:

Datum	Transaktion	Symbol	Stück	Orderkurs	Order-Betrag	Gebühren	Rest-Saldo	Cash	Strategie-Depot
09.10.2024, 22:00	Kauf	SPY	40,5	577,14	-23.398,48	1,00	0,00	Big Picture ETF Strategie	
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	

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									
Konten	Kontostand Währung Notiz									
Cash	11.791,00 USD									
Alle Buchungen										
Berichte										
Vermögensaufstellung										
Diagramm										
Bestand										
Performance										
Berechnung										
Diagramm										
Rendite / Volatilität										
Wertpapiere										
Zahlungen										
Trades										
Klassifizierungen										
Wertpapierart										
Industry Group										
Allgemeine Daten										
Währungen										
Einstellungen										

LURO-Aktien-Strategie mit Markt-Timing auf Basis des Big Pictures im Vergleich zu buy & hold im S&P 500 ab 01.10.2024. Für diese 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 - TP - Rallye-Status - last stable - 315. SPY-Long-Call-Options@Uptrend.xml LURO-Aktien US - long - nach ETF-Timing Big Picture - 10 LUROS -

Mo. 14. Okt. 14:42:20

Wertpapiere + LURO-Aktien US - long - nach ETF-Timing Big Picture - 10 LUROS - vorgefiltert - vs. S&P 500 buy & hold Seit 01.10.2024

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

Mittlere Haltedauer

5 Tage

Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust)

0 ↑ 0 ↓ 0

!! WICHTIGER HINWEIS !!

Die Strategie ist noch nicht praxis-erprobt, weil sie ausschließlich auf Back-Tests beruht und muss noch justiert und verbessert werden.

Die Trades sind nachzuhandeln, ohne zu verstehen, was im Einzelnen die entscheidungsrelevanten Gründe für Kauf und Verkauf sind, wird ausdrücklich nicht empfohlen!

Die Auswahl der Aktien:

- subjektive Auswahl der Aktien im Monats-Chart - 5 bis 10 Jahre LURO bevorzugt, Ausnahmen zulässig
- Filterung der Aktien nach RSL 21, RSL 50 und einem selbst ermittelten Dynamik-Ranking
- Auswahl der Top 10 auf Basis des Dynamik-Rankings

LURO-Aktien

True Time-Weighted Rate of Return

0,79%

ca. Rendite

24,69% p.a.

Maximaler Drawdown

0,67%

Maximale Drawdown Dauer

10 Tage

S&P 500

True Time-Weighted Rate of Return

1,86%

ca. Rendite

96,06% p.a.

Maximaler Drawdown

0,96%

Maximale Drawdown Dauer

4 Tage

Berechnung

Performance-Berechnung

Anfangswert (01.10.2024) 10.000,00

- + Kurserfolge 88,89
- + Realisierte Kurserfolge 0,00
- + Erträge 0,00
- Gebühren 10,00
- Steuern 0,00
- + Cash Fremdwährungsgewinne 0,00
- + Performanceneutrale Bewegungen 0,00

= Endwert (14.10.2024) 10.078,89

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

Jahresrenditen

Gesamtportfolio 0,8

Papertrading!

Die letzten Transaktionen der LURO-Aktien-Strategie.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

Willkommen *IBKR LB.xml SPY - long - Uptrend - Filter - TP - Rallye-Status - last stable - 315. SPY-Long-Call-Options@Uptrend.xml LURO-Aktien US - long - nach ETF-Timing Big Picture - 10 LUROS -

Mo. 14. Okt. 14:43:45

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

Cash

Umsätze Kontosaldenverlauf

Datum	Transaktion	Symbol	Stück	Orderkurs	Order-Betrag	Gebühren	Rest-Saldo	Cash	Strategie-Depot
09.10.2024, 22:00	Kauf	KLAC	1,2	804,63	-1.000,00	1,00	0,00	0,00	LURO-Aktien - Uptrend
09.10.2024, 22:00	Kauf	ARES	6,3	158,16	-1.000,00	1,00	1.000,00	1.000,00	LURO-Aktien - Uptrend
09.10.2024, 22:00	Kauf	APO	7,2	138,02	-1.000,00	1,00	2.000,00	2.000,00	LURO-Aktien - Uptrend
09.10.2024, 22:00	Kauf	IBP	4,2	239,96	-1.000,00	1,00	3.000,00	3.000,00	LURO-Aktien - Uptrend
09.10.2024, 22:00	Kauf	CAVA	76	131,86	-1.000,00	1,00	4.000,00	4.000,00	LURO-Aktien - Uptrend
09.10.2024, 22:00	Kauf	NVDA	7,5	132,65	-1.000,00	1,00	5.000,00	5.000,00	LURO-Aktien - Uptrend
09.10.2024, 22:00	Kauf	QCOM	5,9	170,22	-1.000,00	1,00	6.000,00	6.000,00	LURO-Aktien - Uptrend
09.10.2024, 22:00	Kauf	EXP	3,4	293,15	-1.000,00	1,00	7.000,00	7.000,00	LURO-Aktien - Uptrend
09.10.2024, 22:00	Kauf	SWK	9,4	106,61	-1.000,00	1,00	8.000,00	8.000,00	LURO-Aktien - Uptrend
09.10.2024, 22:00	Kauf	AMP	2	493,24	-1.000,00	1,00	9.000,00	9.000,00	LURO-Aktien - Uptrend
01.10.2024	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: 14.10.2024 ***

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 LURO-Aktien-Strategie

- Die Transaktionen werden im Regelfall zu Börsenschluss-Kursen ausgeführt.
- Es werden Bruchstücke der jeweiligen Aktien gehandelt, damit eine 100 %ige Investition möglich ist.
- Je Transaktion wird 1 USD Brokergebühren berücksichtigt.
- Es werden keine Steuern berücksichtigt.

Ideen und Kritik zu Verbesserung sind herzlich willkommen.

👉 Let's rock the Wall Street and may the force of money be with you! 👈