

Uneinheitlicher Handel gestern an der Wall Street. Während es in den ersten beiden Dritteln des Handelstages so aussah, als ob alle Indices erneut Gewinne verbuchen könnten, ließ im letzten Drittel die Kaufdynamik nach und die Indices gaben Tagesgewinne größtenteils wieder ab. Zur Schlussglocke verbleiben leichte Verluste bis leicht Gewinne.

Der Handelsumsatz war an der Nasdaq höher gegenüber Vortag und Durchschnitt, an der NYSE leicht höher gegenüber dem Vortag, aber unter dem Durchschnitt.



(Quelle: [finviz.com](https://finviz.com))

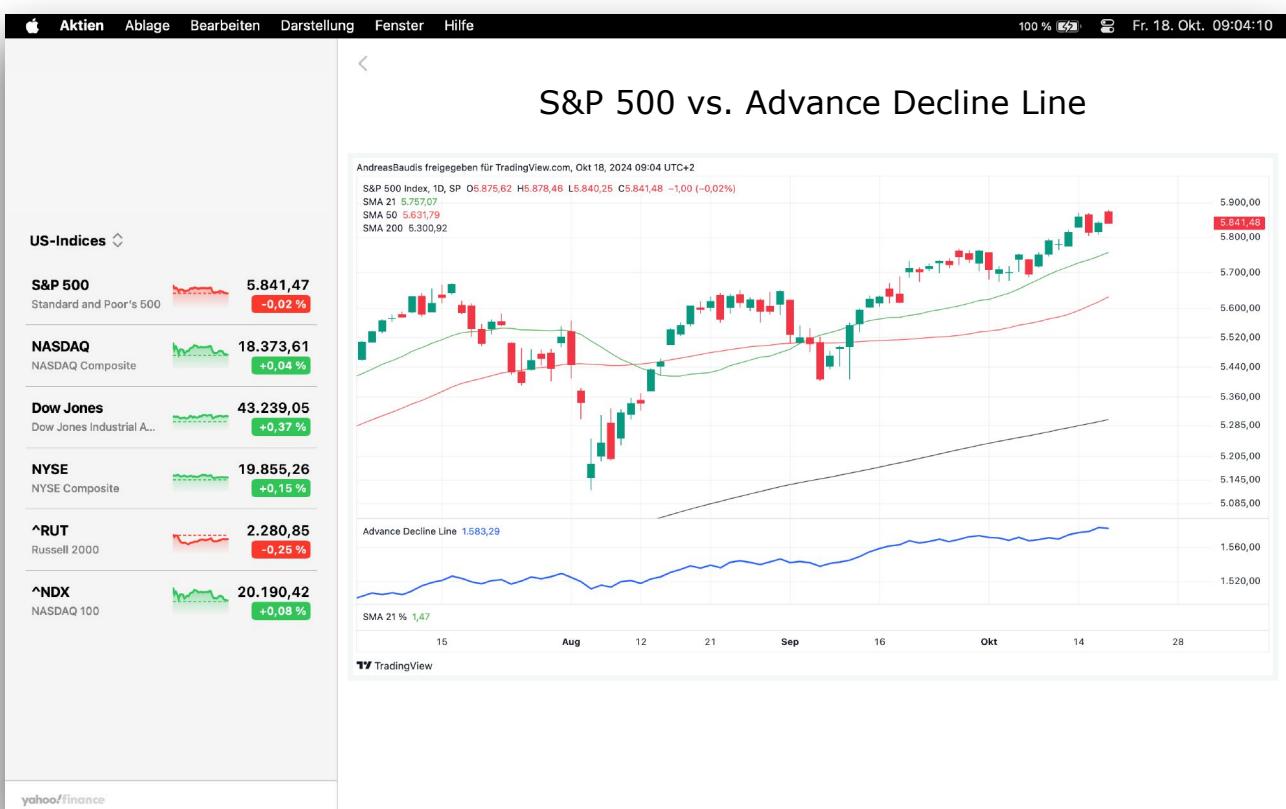
Der Gesamt-Markt bleibt im Aufwärtstrend.

Ausblick: der Aufwärtstrend setzt sich weiter zäh fort und der Markt könnte aufgrund der kommenden Präsidentschaftswahlen in den USA am 05.11.2024 volatiler sein

#### Bedingungs-Order für die Index-Strategien:

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

StopLoss bei einem SPX-Kurs von: 5.613,00 (Notstopp, wird täglich und ausschließlich nach oben nachgezogen)



## Wichtige Termine USA heute:

18. Oktober 2024				
<b>Baubeginne</b>				
	–	1.324 M	1.356 M	
<b>14:30</b>	Aktuell	Prognose	Vorherige	
<b>Baugenehmigungen</b>				
	–	1.404 M	1.475 M	
<b>14:30</b>	Aktuell	Prognose	Vorherige	
<b>Baubeginne m/m</b>				
	–	-4.2%	9.6%	
<b>14:30</b>	Aktuell	Prognose	Vorherige	
<b>Baugenehmigungen, m/m</b>				
	–	-1.7%	4.9%	
<b>14:30</b>	Aktuell	Prognose	Vorherige	
<b>Fed Präsident Waller spricht</b>				
	–	–	–	
<b>18:10</b>	Aktuell	Prognose	Vorherige	
<b>Baker Hughes Ölplattformzählung</b>				
	–	–	481	
<b>19:00</b>	Aktuell	Prognose	Vorherige	
<b>Baker Hughes US, Gesamtzahl der Ölförderanl...</b>				
	–	–	586	
<b>19:00</b>	Aktuell	Prognose	Vorherige	
<b>Staatshaushalt</b>				
	–	\$-138.3 B	\$-380.1 B	
<b>20:00</b>	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	Before Open		
 <b>KAROOOOO</b>		 <b>WALGREENS BOOTS ALLIANCE</b>	 <b>UAL</b>	 <b>ASML</b>	 <b>AA</b>	 <b>TSM</b>	 <b>NFLX</b>	 <b>CMA</b>			
		 <b>UNITEDHEALTH GROUP</b>	 <b>IBKR</b>	 <b>MS</b>	 <b>REXR</b>	 <b>TRV</b>	 <b>ISRG</b>	 <b>SLB</b>			
		 <b>CITI</b>	 <b>J.B. HUNT</b>	 <b>ABT</b>	 <b>KINDER MORGAN</b>	 <b>ELV</b>	 <b>CROWN</b>	 <b>AXP</b>			
		 <b>BANK OF AMERICA</b>	 <b>PNFP</b>	 <b>USB</b>	 <b>PPG</b>	 <b>CSX</b>	 <b>COK</b>	 <b>P&amp;G</b>			
		 <b>JOHNSON &amp; JOHNSON</b>	 <b>EPAC</b>	 <b>CFG</b>	 <b>FHN</b>	 <b>STLD</b>	 <b>INFY</b>	 <b>WAT</b>			
		 <b>PROGRESSIVE</b>	 <b>EPAC</b>	 <b>SYF</b>	 <b>FIRST HORIZON</b>	 <b>FIR</b>	 <b>TCBI</b>	 <b>WAD</b>			
		 <b>CHARLES SCHWAB</b>	 <b>EQBK</b>	 <b>FCCO</b>	 <b>HOMD</b>	 <b>HDF</b>	 <b>INFO</b>	 <b>WAN</b>			
		 <b>GOLDMAN SACHS</b>	 <b>BANCSHARES</b>	 <b>FCCO</b>	 <b>PROLOGIS</b>	 <b>DISCOVER</b>	 <b>EFX</b>	 <b>OCFC</b>			
		 <b>PNC</b>	 <b>OMC</b>	 <b>FULT</b>	 <b>OFG</b>	 <b>EQUIFAX</b>	 <b>CMC</b>	 <b>OCFC</b>			
		 <b>STATE STREET</b>	 <b>FULT</b>					 <b>SFNC</b>			
									 <b>ACU</b>		
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.

Willkommen IBKR LB.xml \*SPY - long - Uptrend - Filter - TP - X SPY-Long-Call-Options@Uptrend.x \*LURO-Aktien US - long - nach ETF LURO-Aktien US - long - nach ETF-A0NGW1 - buy & hold.xml

Fr. 18. Okt. 09:07:06

### SPY-ETF-Strategie mit Markt-Timing auf Basis des Big Pictures vs. S&P 500 buy & hold

#### SPY-ETF-Strategie

True Time-Weighted Rate of Return  
**136,09%**  
ca. Rendite  
**13,65% p.a.**  
Maximaler Drawdown  
**5,08%**  
Maximale Drawdown Dauer  
**265 Tage**  
Mittlere Haltedauer  
**26 Tage**  
Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust)  
**26 ↑19 ↓7**

#### S&P 500

True Time-Weighted Rate of Return  
**107,00%**  
ca. Rendite  
**11,45% p.a.**  
Maximaler Drawdown  
**33,92%**  
Maximale Drawdown Dauer  
**746 Tage**

#### Berechnung

Performance-Berechnung	
Anfangswert (01.02.2018)	<b>10.000,00</b>
+ Kurserfolge	211,22
+ Realisierte Kurserfolge	13.451,48
+ Erträge	0,00
- Gebühren	54,00
- Steuern	0,00
+ Cash Fremdwährungsgewinne	0,00
+ Performanceneutrale Bewegungen	0,00
= Endwert (18.10.2024)	<b>23.608,70</b>

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



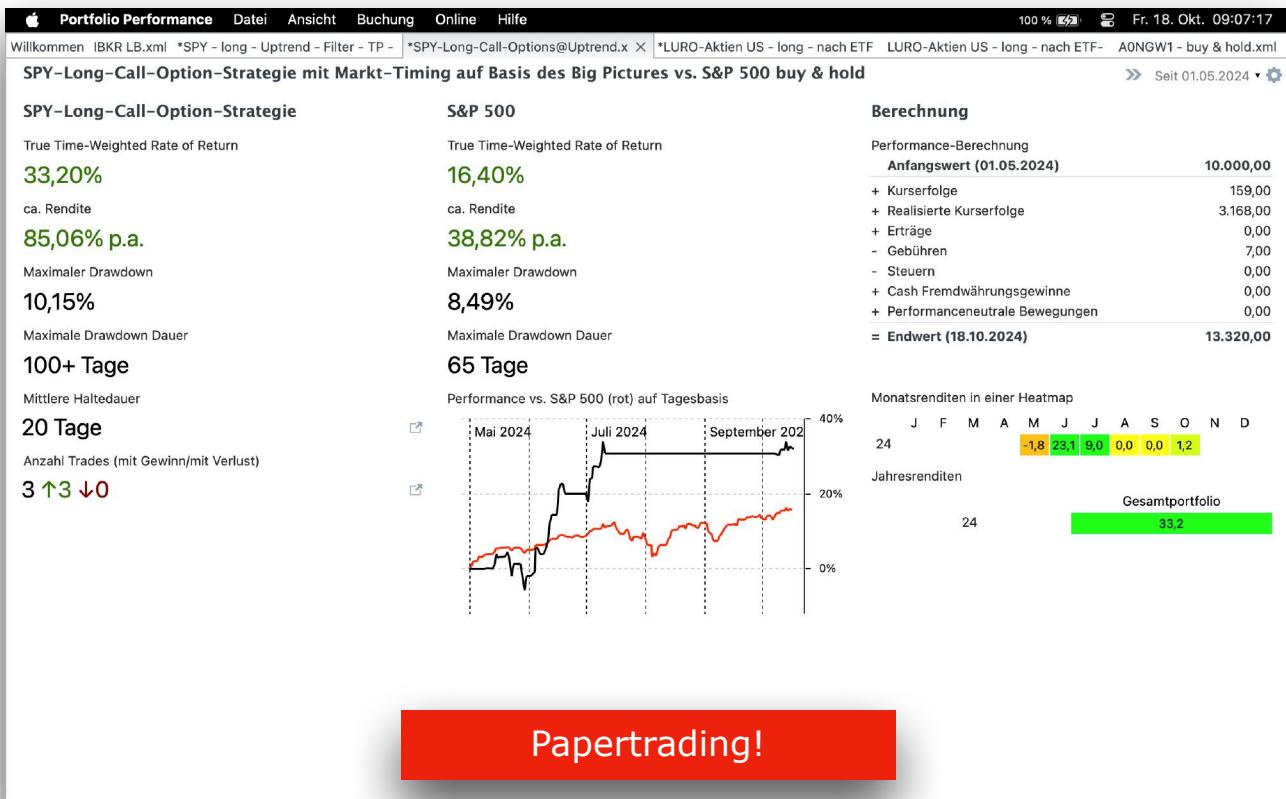
#### Jahresrenditen

Jahresrenditen	Gesamtpfotolio
18	3,6
19	18,2
20	28,5
21	12,2
22	2,4
23	13,2
24	15,5

Papertrading!

## Die letzten Transaktionen der SPY-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.

**Konten**

Konto Kontostand Währung Notiz

Cash	11.791,00	USD
------	-----------	-----

**Cash**

Umsätze Kontosaldenverlauf

Datum	Transaktion	Symbol	Stück (Anzahl x Faktor)	Orderkurs	Order-Betrag	Gebühren	Rest-Saldo	Cash	Notiz
09.10.2024, 22:00	Kauf	SPY241220C00585000	100	13,70	-1.371,00	1,00	11.791,00		Fortsetzung des Aufwärtstrends nach Seitwärtsbewegung
11.07.2024, 17:41	Verkauf	SPY240830C0053000	200	14,94	2.987,00	1,00	13.162,00		SL - SPX < Tief Vortag, nach 7 Tage in Folge + hH & hT
02.07.2024, 22:00	Kauf	SPY240830C0053000	200	9,52	-1.905,00	1,00	10.175,00		Fortsetzung des Aufwärtstrends
20.06.2024, 18:30	Verkauf	SPY240719C00525000	100	24,11	2.410,00	1,00	12.080,00		SL nach Anpassung des SL-Kurses - NDX/NDQ am Vortag 7 r
20.06.2024, 18:30	Verkauf	SPY240719C00535000	100	15,53	1.552,00	1,00	9.670,00		SL nach Anpassung des SL-Kurses - NDX/NDQ am Vortag 7 r
15.05.2024, 22:00	Kauf	SPY240719C00535000	100	8,52	-853,00	1,00	8.818,00		FTD im NDQ - Restlaufzeit: 65 Tage Delta ca.: 0,5 offene Kon
09.05.2024, 22:00	Kauf	SPY240719C00525000	100	10,28	-1.029,00	1,00	8.871,00		erstmalig Wechsel von Korrektur auf Verkaufssdruck; daher nu
01.05.2024	Einlage				10.000,00		10.000,00		US-Markt in Korrektur

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 100 % Fr. 18. Okt. 09:08:33

Willkommen IBKR LB.xml \*SPY - long - Uptrend - Filter - TP - \*SPY-Long-Call-Options@Uptrend.x \*LURO-Aktien US - long - nach ETF- LURO-Aktien US - long - nach ETF- A0NGW1 - buy & hold.xml

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

**LURO-Aktien** **S&P 500** **Berechnung**

True Time-Weighted Rate of Return  
**2,17%** True Time-Weighted Rate of Return  
**2,32%**

ca. Rendite  
**58,57% p.a.** ca. Rendite  
**68,93% p.a.**

Maximaler Drawdown  
**2,08%** Maximaler Drawdown  
**0,96%**

Maximale Drawdown Dauer  
**10 Tage** Maximale Drawdown Dauer  
**4 Tage**

Mittlere Haltedauer  
**8 Tage**

Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust)  
**1 ↑ 0 ↓ 1**

kommende Quartalszahlen (10)

- Ameriprise Financial, Inc. Termin: 23.10.2024
- Eagle Materials Inc. Termin: 29.10.2024
- Stanley Black & Decker, Inc. Termin: 29.10.2024
- Installed Building Products, Inc. Termin: 31.10.2024
- Ares Management Corporation Termin: 01.11.2024
- T. Rowe Price Group, Inc.

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

Jahresrenditen

Gesamtportfolio 24 2,2

**!! WICHTIGE HINWEISE !!**

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

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

Die Auswahl der Aktionen:

- 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

**Papertrading!**

## Die letzten Transaktionen der LURO-Aktien-Strategie.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe 100 % Do. 17. Okt. 12:13:30

Willkommen IBKR LB.xml SPY - long - Uptrend - Filter - TP - R \*SPY-Long-Call-Options@Uptrend.x LURO-Aktien US - long - nach ETF- LURO-Aktien US - long - nach ETF- A0NGW1 - buy & hold.xml

Konten

Konto	Kontostand	Währung	Notiz
Cash	0,00 USD		

**Cash**

Umsätze Kontosaldenverlauf

Datum	Transaktion	Symbol	Stück	Orderkurs	Order-Betrag	Gebühren	Rest-Saldo	Cash	Notiz
16.10.2024, 21:50	Kauf	TROW	8	111,52	-898,66	1,00	0,00		Ersatz-Invest für KLAC
15.10.2024, 18:36	Verkauf	KLAC	1,2	724,62	898,66	1,00	898,66		Kurs < SMA 50 bei hohem Umsatz und kräftigem Tagesverlust
09.10.2024, 22:00	Kauf	SWK	9,4	106,61	-1.000,00	1,00	0,00		Fortsetzung Aufwärtstrend nach Seitwärtsbewegung
09.10.2024, 22:00	Kauf	APO	7,2	138,02	-1.000,00	1,00	1.000,00		Fortsetzung Aufwärtstrend nach Seitwärtsbewegung
09.10.2024, 22:00	Kauf	IBP	4,2	239,96	-1.000,00	1,00	2.000,00		Fortsetzung Aufwärtstrend nach Seitwärtsbewegung
09.10.2024, 22:00	Kauf	EXP	3,4	293,15	-1.000,00	1,00	3.000,00		Fortsetzung Aufwärtstrend nach Seitwärtsbewegung
09.10.2024, 22:00	Kauf	CAVA	7,6	131,86	-1.000,00	1,00	4.000,00		Fortsetzung Aufwärtstrend nach Seitwärtsbewegung
09.10.2024, 22:00	Kauf	ARES	6,3	158,16	-1.000,00	1,00	5.000,00		Fortsetzung Aufwärtstrend nach Seitwärtsbewegung
09.10.2024, 22:00	Kauf	QCOM	5,9	170,22	-1.000,00	1,00	6.000,00		Fortsetzung Aufwärtstrend nach Seitwärtsbewegung
09.10.2024, 22:00	Kauf	NVDA	7,5	132,65	-1.000,00	1,00	7.000,00		Fortsetzung Aufwärtstrend nach Seitwärtsbewegung
09.10.2024, 22:00	Kauf	AMP	2	493,24	-1.000,00	1,00	8.000,00		Fortsetzung Aufwärtstrend nach Seitwärtsbewegung
09.10.2024, 22:00	Kauf	KLAC	1,2	804,63	-1.000,00	1,00	9.000,00		Fortsetzung Aufwärtstrend nach Seitwärtsbewegung
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](http://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.

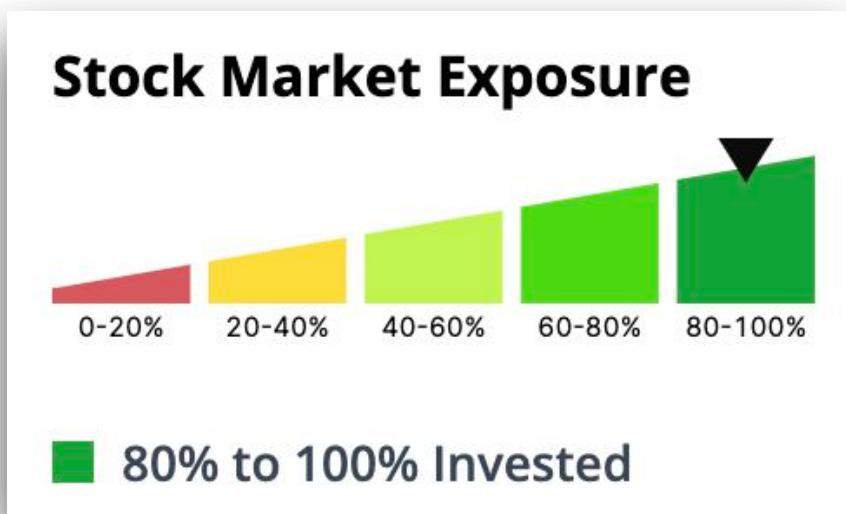
Im Gegenzug ist es einfacher und mit weniger Risiko verbunden, wenn man einen Aufwärtstrend im Gesamtmarkt für den Kauf einzelner Aktien nutzt (Rückenwind).

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! 🤘