

US-Markets - The Big Picture & Strategies

Donnerstag, 24. Oktober 2024

Gemeinsam zogen die Indices gestern an der Wall Street nach Süden und hinterließen am Ende des Handelstages leichte bis kräftige Verluste. Der NDQ führte die Verlierer mit - 1,60 % an, während der NYA mit nur - 0,30 % davon kam.

Der Handelsumsatz war an der Nasdaq geringer gegenüber dem Vortag, aber höher gegenüber dem Durchschnitt. An der NYSE war der Umsatz dagegen höher gegenüber dem Vortag, aber unter dem Durchschnitt.

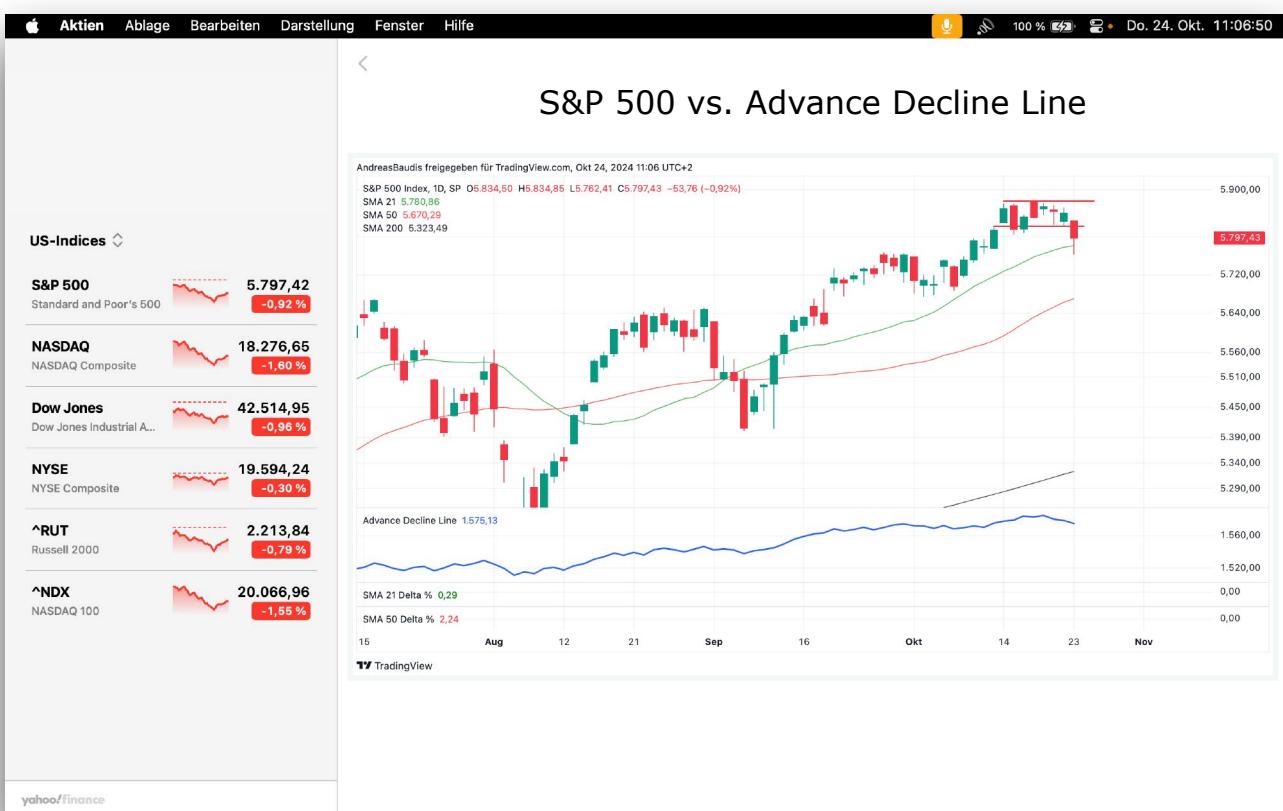


(Quelle: [finviz.com](#))

Der SPX hat gestern die Unterstützung bei ca. 5.822 Punkten mit leicht höherem Umsatz gegenüber dem Vortag nach unten durchbrochen. Drei von sechs Indices schlossen unter ihrem SMA 21, während die anderen drei Indices den SMA 21 nur Intraday kurzfristig unterschritten hatten.

Der Gesamt-Markt bleibt im Aufwärtstrend, aber das Eis wird dünner, da zunehmender Verkaufsdruck erkennbar ist.
Ausblick: kurzfristig volatil seitwärts.

Die Index-Strategien SPY-ETF und SPY-Long-Call-Option wurden gestern aufgrund schlechter Preisperformance geschlossen. Nun heißt es wieder warten auf die nächste Gelegenheit zum Einstieg, idealerweise, wenn das Big-Picture von rot oder gelb auf grün wechselt.



Wichtige Termine USA heute:

24. Oktober 2024			
Erstanträge auf Arbeitslosenhilfe			
	-	230 K	241 K
14:30	Aktuell	Prognose	Vorherige
Verkäufe von Neubauten			
	-	0.692 M	0.716 M
16:00	Aktuell	Prognose	Vorherige
Verkäufe von Neubauten m/m			
	-	2.0%	-4.7%
16:00	Aktuell	Prognose	Vorherige

Die wichtigsten Quartalsergebnisse der Woche.

EARNINGS WHISPERS		Most Anticipated Earnings Releases for the week beginning October 21, 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
DYNEX CAPITAL INC. [DX]	SAP [SAP]	verizon [VZ]	ENPHASE [ENPH]	VERTIV [VRT]	TESLA [TSLA LRCK]	American Airlines [AAL]	Dexcom [DXCM]	NYCB [NYCB]	
陆金所控股 LUFAX [LU]	NUCOR [NUE]	GM [GM]	brandwine [BON]	BOEING [BA]	BOEING [BA]	ups [UPS]	DECKERS BRANDS [DECK]	CYB [CYB]	
Kaspi.kz [RSP]	Berkley [WRB]	RTX [RTX]	SEAGATE [STX]	AT&T [T]	AT&T [T]	Lam RESEARCH [LAMR]	Western Digital [WDC]	COLGATE-PALMOLIVE [CL]	
Sandy Spring Bank [SASR]	BOK FINANCIAL [BOKF]	3M [MMM]	Baker Hughes [BKR]	Coca-Cola [KO]	Coca-Cola [KO]	IBM [IBM]	SKECHERS [SKX]	PIPER Sandler [PIPR]	
HBT Financial [HBT]	logitech [LOGI]	FREIGHT McMILLAN COPPER & GOLD [FMC]	CN [CNI]	GE VERNONA [GEV]	GE VERNONA [GEV]	Celestica [CLS]	Edwards [EW]	CENTENE Corporation [CNC]	
Guaranty Bank & Trust [GNY]	ZIONS BANCORPORATION [ZION]	GE Aerospace [GE]	volaris [LMT]	Thermo Fisher SCIENTIFIC [TMO]	Viking Therapeutics [VIKT]	Newmont [NEM]	BOYD [COUR]	Booz Allen Hamilton [AON]	
PREFERRED BANK [PFBC]	AGNC INVESTMENT CORP. [AGNC]	LOCKHEED MARTIN A [DGX]	Texas Instruments [TXN]	CME Group [CME]	QuantumScape [QS]	servicenow [NOW]	coursera [CARR]	AVTR [AVTR]	
WASH [WASH]	WASHINGTON TRUST HOLDING CO. [TFB]	Quest Diagnostics [FI]	NABORS [NBR]	Boston Scientific [BSX]	*Mobile* [TMO]	GENERAL DYNAMICS [GD]	TRACTOR SUPPLY CO. [UNP]	SAIA [SAIA]	
TFI International [RLI]	fiserv. [DENN]	PennyMac [PFSI]	Matador [MTDR]	LVS [LVS]	Sands LAS VEGAS SANDS CORP. [SNDZ]	UNION PACIFIC RAILROAD [UNP]	Oppfolio [OPPF]	newell BRANDS [NWL]	WISDOMTREE [WT]
http://eps.sh/cal	Denny's [DENN]								

© 2024 Earnings Whispers

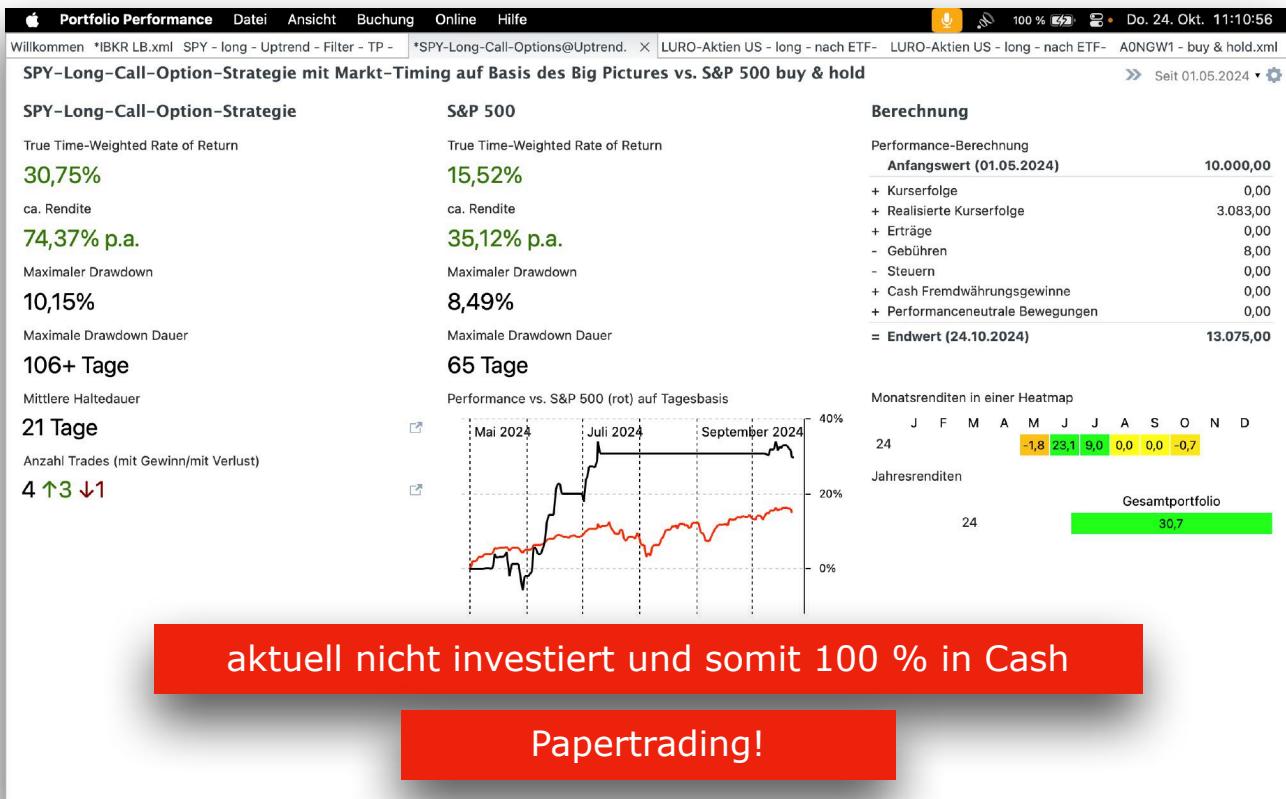
SPY-ETF-Strategie mit Markt-Timing auf Basis des Big Picture im Vergleich zu buy & hold im S&P 500 ab 01.02.2018. Für die ETF-Strategie sind zusätzliche Regeln für Gewinnmitnahmen und Verlustbegrenzung erforderlich. Die Strategie dient in erster Linie dem direkten Vergleich zwischen buy & hold und Markt-Timing.



Die letzten Transaktionen der SPY-ETF-Strategie.

Konten								
Konto	Kontostand Währung Notiz							
Cash	23.485,26 USD							
Cash								
Datum	Transaktion	Symbol	Stück	Orderkurs	Order-Betrag	Gebühren	Rest-Saldo	Cash Notiz
23.10.2024, 17:15	Verkauf	SPY	40,5	579,33	23.485,26	1,00	23.485,26	SL manuell wg. schlechter Preisperformance SPX - Ausbruch
09.10.2024, 22:00	Kauf	SPY	40,5	577,14	-23.398,48	1,00	0,00	Fortsetzung des Aufwärtstrends nach Seitwärtsbewegung
11.07.2024, 17:41	Verkauf	SPY	42	556,65	23.398,48	1,00	23.398,48	SL - SPX < Tief Vortag, nach 7 Tage in Folge + / hH & hT
02.07.2024	Kauf	SPY	42	549,01	-23.079,32	1,00	0,00	Fortsetzung des Aufwärtstrends
20.06.2024, 18:30	Verkauf	SPY	42,2	546,50	23.079,32	1,00	23.079,32	SL nach Anpassung des SL-Kurses - NDX/NDQ am Vortag 7
15.05.2024	Kauf	SPY	20,9	529,78	-11.085,70	1,00	0,00	FTD im NDQ
09.05.2024	Kauf	SPY	21,3	520,17	-11.085,69	1,00	11.085,70	erstmalig Wechsel von Korrektur auf Verkaufdruck; daher
07.03.2024	Verkauf	SPY	43,1	514,81	22.171,39	1,00	22.171,39	TP % von Tief davor im SPX
08.01.2024	Kauf	SPY	43,1	474,60	-20.441,58	1,00	0,00	SPX close 0,5% ≥ SMA 21 uptrend resumes IBD Powertrend
22.11.2023	Verkauf	SPY	44,9	455,02	20.441,58	1,00	20.441,58	TP % SMA 21 im SPX
01.11.2023	Kauf	SPY	44,9	422,66	-18.989,75	1,00	0,00	FTD im NDQ
19.10.2023	Verkauf	SPY	44,5	426,43	18.989,75	1,00	18.989,75	SPX close -0,5% ≤ SMA 21 uptrend under pressure
06.10.2023	Kauf	SPY	44,5	429,54	-19.130,25	1,00	0,00	FTD im NDQ
16.06.2023	Verkauf	SPY	43,5	439,46	19.130,25	1,00	19.130,25	TP SPX 12 Tage in Folge hH/hT oder Tagesgewinn
17.05.2023	Kauf	SPY	43,5	415,23	-18.077,43	1,00	0,00	SPX close 0,5% ≥ SMA 21 uptrend resumes
03.05.2023	Verkauf	SPY	44,3	408,02	18.077,43	1,00	18.077,43	SPX close -0,5% ≤ SMA 21 uptrend under pressure
27.04.2023	Kauf	SPY	44,3	412,41	-18.273,94	1,00	0,00	SPX close 0,5% ≥ SMA 21 uptrend resumes
25.04.2023	Verkauf	SPY	45	406,08	18.273,94	1,00	18.273,94	SPX close -0,5% ≤ SMA 21 uptrend under pressure
29.03.2023	Kauf	SPY	45	401,35	-18.063,07	1,00	0,00	FTD im SPX und NDQ
29.07.2022	Verkauf	SPY	43,8	411,99	18.063,07	1,00	18.063,07	TP % vom Buypoint im SPX
15.07.2022	Kauf	SPY	43,8	385,13	-16.887,37	1,00	0,00	SPX close 0,5% ≥ SMA 21 uptrend resumes
22.04.2022	Verkauf	SPY	39,6	426,04	16.887,37	1,00	16.887,37	Rallye zu 90 % fehlgeschlagen
19.04.2022	Kauf	SPY	39,6	445,04	-17.642,54	1,00	0,00	FTD im DJIA

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	13.075,00	USD							
Cash									
Datum	Transaktion	Symbol	Stück (Anzahl x Faktor)	Orderkurs	Order-Betrag	Gebühren	Rest-Saldo	Cash	Notiz
23.10.2024, 17:15	Verkauf	SPY241220C00585000	100	12,85	1.284,00	1,00	13.075,00		SL manuell wg. schlechter Preisperformance SPX - Ausbruch
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	SPY240830C00553000	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	SPY240830C00553000	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	8.971,00		erstmalig Wechsel von Korrektur auf Verkaufsdruck; 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

Willkommen *IBKR LB.xml SPY - long - Uptrend - Filter - TP - *SPY-Long-Call-Options@Uptrend LURO-Aktien US - long - nach ETF- LURO-Aktien US - long - nach ETF- AONGW1 - buy & hold.xml

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

Do. 24. Okt. 11:12:18 Seit 01.10.2024

LURO-Aktien	S&P 500	Berechnung
True Time-Weighted Rate of Return -0,15%	True Time-Weighted Rate of Return 1,55%	Performance-Berechnung Anfangswert (01.10.2024) 10.000,00
ca. Rendite -2,34% p.a.	ca. Rendite 29,14% p.a.	+ Kurserfolge 96,46 + Realisierte Kurserfolge -99,34 + Erträge 0,00 - Gebühren 12,00 - Steuern 0,00 + Cash Fremdwährungsgewinne 0,00 + Performanceneutrale Bewegungen 0,00 = Endwert (24.10.2024) 9.985,12
Maximaler Drawdown 2,91%	Maximaler Drawdown 1,15%	
Maximale Drawdown Dauer 10 Tage	Maximale Drawdown Dauer 5 Tage	
Mittlere Haltedauer 14 Tage	Performance vs. S&P 500 (rot) auf Tagesbasis	Jahresrenditen
Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust) 1 ↑ 0 ↓ 1		Gesamtportfolio 24 -0,1 !! WICHTIGE HINWEISE !!
kommende Quartalszahlen (9)		Die Strategie ist noch nicht praxis-erprobt, weil sie ausschließlich auf Back-Tests beruht und muss noch justiert und verbessert werden.
Eagle Materials Inc Termin: 29.10.2024		Die Trades blind nachzuhandeln, ohne zu verstehen, was im Einzelnen die entscheidungsrelevanten Gründe für Kauf und Verkauf sind, wird ausdrücklich nicht empfohlen!
Stanley Black & Decker, Inc. Termin: 29.10.2024		
Installed Building Products, In Termin: 31.10.2024		
Ares Management Corporation Termin: 01.11.2024		
T. Rowe Price Group, Inc. Termin: 01.11.2024		
Apollo Global Management, Inc.		

Papertrading!

Die letzten Transaktionen der LURO-Aktien-Strategie.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

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- AONGW1 - buy & hold.xml

Do. 17. Okt. 12:13:30

Konten							
Konto	Kontostand	Währung	Notiz				
Cash	0,00 USD						
Cash							
<input checked="" type="checkbox"/> Umsätze	<input type="checkbox"/> Kontosaldenverlauf						
Datum	Transaktion	Symbol	Stück	Orderkurs	Order-Betrag	Gebühren	Rest-Saldo
16.10.2024, 21:50	Kauf	TROW	8	111,52	-898,66	1,00	0,00
15.10.2024, 18:36	Verkauf	KLAC	1,2	724,62	898,66	1,00	898,66
09.10.2024, 22:00	Kauf	SWK	9,4	106,61	-1.000,00	1,00	0,00
09.10.2024, 22:00	Kauf	APO	7,2	138,02	-1.000,00	1,00	1.000,00
09.10.2024, 22:00	Kauf	IBP	4,2	239,96	-1.000,00	1,00	2.000,00
09.10.2024, 22:00	Kauf	EXP	3,4	293,15	-1.000,00	1,00	3.000,00
09.10.2024, 22:00	Kauf	CAVA	7,6	131,86	-1.000,00	1,00	4.000,00
09.10.2024, 22:00	Kauf	ARES	6,3	158,16	-1.000,00	1,00	5.000,00
09.10.2024, 22:00	Kauf	QCOM	5,9	170,22	-1.000,00	1,00	6.000,00
09.10.2024, 22:00	Kauf	NVDA	7,5	132,65	-1.000,00	1,00	7.000,00
09.10.2024, 22:00	Kauf	AMP	2	493,24	-1.000,00	1,00	8.000,00
09.10.2024, 22:00	Kauf	KLAC	1,2	804,63	-1.000,00	1,00	9.000,00
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! 🤘