

Die Wall Street startete die Handelswoche gestern mit gemischten Ergebnissen. Während die technologielastigen Indices NDQ und NDX gemeinsam mit dem SPX nicht so recht vom Fleck kamen, legten DJIA, NYA und RUT leicht bis solide zu. Der RUT führte die Tagesgewinner an.

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



(Quelle: finviz.com)

Intraday erreichte der SPX ein neues ATH, konnte dieses aber nicht bis zum Schluß halten. NDQ, DJIA und NYA dagegen erreichten sowohl Intraday als auch auf Schlusskursbasis neue ATHs. Dem RUT fehlt nur ein Tagessieg von knapp 1 % um auch wieder ein ATH zu markieren und das letzte ATH vom November 2021 hinter sich zu lassen.

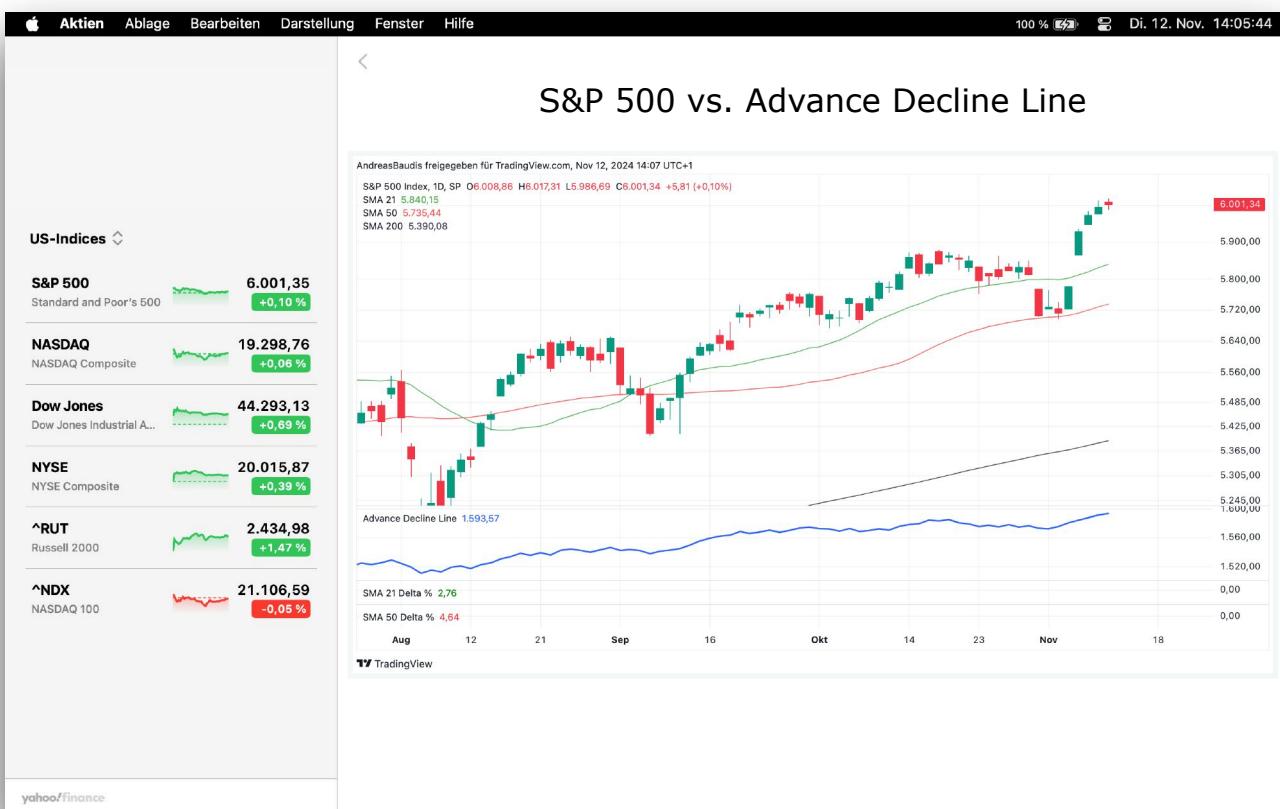
Der Gesamt-Markt befindet sich weiterhin im Aufwärtstrend und die Indices eilen von einem Rekord zum nächsten - hoffen wir mal, dass der Markt nicht überhitzt.

Ausblick: Fortsetzung der Trump-Rallye

Bedingungs-Order für die Index-Strategien:

TakeProfit bei einem SPX-Kurs von: 6.295 (fix)

StopLoss bei einem SPX-Kurs von: 5.694 (Notstopp, wird täglich und ausschließlich nach oben nachgezogen)



Wichtige Termine USA heute:

12. November 2024

Fed Präsident Waller spricht

 - - -

16:00 Aktuell Prognose Vorherige

Die wichtigsten Quartalsergebnisse der Woche.

EARNINGS WHISPERS		Most Anticipated Earnings Releases for the week beginning November 11, 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
MONDY monday.com	ZETA ZETA	SHOP shopify	SOUN SoundHound	HUT HUT 8	CSCO CISCO	DIS Disney	APPLIED MATERIALS Applied Materials	BABA Alibaba Group	
ICL ARAKIKI	GRAB Grab	PLUG Plug	MARA Marathon	CYBR Cyberark	DLO d-local	TLN Talen Energy	ASTS AST SpaceMobile	AIM AIM	
aramark ARMK	LAZR Luminar	THE HUT The HUT	CAVA CAVA	LODA Liquidity	KULR KULR	LUNR Intuitive Machines	OKLO OKLO	Spectrum Brands	
LINC LINCOLN TECH	LIVN Live Nation Entertainment	SE Sea	SPOT Spotify	HIVE Hive	BEAZER Beazer Homes	NICE NICE	despegar Post	WISA WISA	
GSL GLOBAL SHIP LEASE	ASSETTOS Assettos	ONON Onn	OXY OXY	TSEM Tower Semiconductor	BZHI Bionano Genomics	BBNGO Bionano Genomics	Globant iZEA	BPTH Bio-Path Holdings	NEXN nexxen
NUWE nuwellis	ANGI ANGI Home Services	HITZ Hertz	RKLT Rocket	SSYS Stratasys	SMSI SurfMicro Software	SMSI SurfMicro Software	INNOV Innov	IPW iPOWER	
BMTH Rockwell Medical	ASSURED Assured Guaranty	NVAX Novavax	RKT Rocket Companies, Inc.	FULC Fulcrum Therapeutics	ARCO Arcos Dorados	TEK Tetra Tech	OCUL Ocular Therapeutics	ORGX Origin	
RDNT RadNet	DOUBLE DOWN Double Down Interactive	BITF Bitfarms	INOVIZ Innoviz Technologies	INVZ Innoviz Technologies	BITM Bitcoin Depot	HP HP			
SPNS Sapiens	VAAALCO Vaalco Energy	ALTI altimmune	ROCKET Rocket Companies, Inc.	ARCO Arcos Dorados					
BRDCTY Bridgestone	STEREOTAXIS Stereotaxis	CRON Cronos Group	TERAWULF Terawulf	CART Instacart					
© 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 ausschließlich dem direkten Vergleich zwischen buy & hold und Markt-Timing.

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.xls

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

137,91%

ca. Rendite

13,63% p.a.

Maximaler Drawdown

5,08%

Maximale Drawdown Dauer

265 Tage

Mittlere Haltedauer

25 Tage

Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust)

27 ↑20 ↓7

S&P 500

True Time-Weighted Rate of Return

112,66%

ca. Rendite

11,77% p.a.

Maximaler Drawdown

33,92%

Maximale Drawdown Dauer

746 Tage

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



Berechnung

Performance-Berechnung

Anfangswert (01.02.2018)	10.000,00
+ Kurserfolge	306,74
+ Realisierte Kurserfolge	13.540,26
+ Erträge	0,00
- Gebühren	56,00
- Steuern	0,00
+ Cash Fremdwährungsgewinne	0,00
+ Performanceneutrale Bewegungen	0,00
= Endwert (12.11.2024)	23.791,00

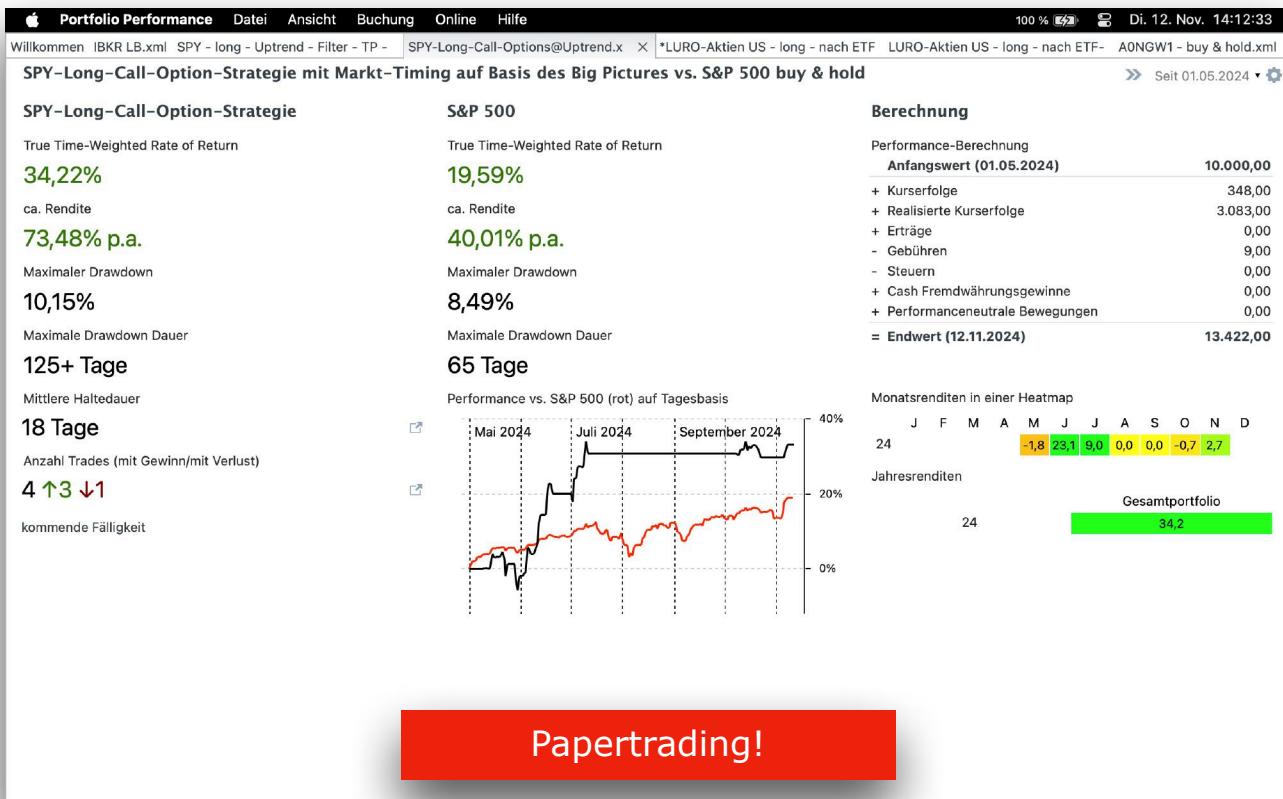
Jahresrenditen

	Gesamtpool
18	3,6
19	18,2
20	28,5
21	12,2
22	2,4
23	13,2
24	16,4

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.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

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

Konten

Konto Kontostand Währung Notiz

Cash 11.695,00 USD

Cash

Umsätze Kontosaldenverlauf

Datum Transaktion Symbol Stück (Anzahl) Orderkurs Order-Betrag Gebühren Rest-Saldo Cash Notiz

06.11.2024, 22:00 Kauf SPY250117C00595000 100 13,79 -1.380,00 1,00 11.695,00 SPX close 0,5% ≥ SMA 21 uptrend resumes Delta: 0,52 Restlaufzeit: 72

23.10.2024, 17:10 Verkauf SPY241220C00585000 100 12,85 1.284,00 1,00 13.075,00 SL manuell wg. schlechter Preisperformance SPX - Ausbruch aus Seitwärtsbewegung

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 mal in Folge

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 mal in Folge

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 Kontrakte ca.:

09.05.2024, 22:00 Kauf SPY240719C00525000 100 10,28 -1.029,00 1,00 8.971,00 erstmalig Wechsel von Korrektur auf Verkaufsdruk; daher nur 50% Pos

01.05.2024 Einlage 10.000,00 10.000,00 US-Markt in Korrektur

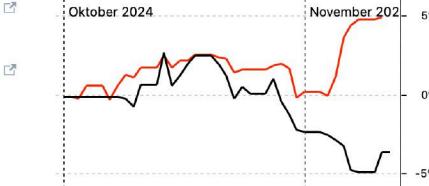
LURO-Aktien-Strategie mit Markt-Timing auf Basis des Big Pictures im Vergleich zu buy & hold im S&P 500 ab 01.10.2024. Für diese Strategie sind analog zur ETF-Strategie zusätzliche Regeln für Gewinnmitnahmen und Verlustbegrenzung erforderlich.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe 100 % Di. 12. Nov. 14:13:24

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	True Time-Weighted Rate of Return	Performance-Berechnung
-3,57%	5,13%	Anfangswert (01.10.2024) 10.000,00
ca. Rendite	ca. Rendite	+ Kurserfolge -84,91
-27,09% p.a.	56,05% p.a.	+ Realisierte Kurserfolge -239,11
Maximaler Drawdown	Maximaler Drawdown	+ Erträge 0,00
7,51%	2,71%	- Gebühren 33,00
Maximale Drawdown Dauer	Maximale Drawdown Dauer	- Steuern 0,00
29+ Tage	19 Tage	+ Cash Fremdwährungsgewinne 0,00
Mittlere Haltedauer	Performance vs. S&P 500 (rot) auf Tagesbasis	+ Performanceneutrale Bewegungen 0,00
13 Tage		= Endwert (12.11.2024) 9.642,98
Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust)		Jahresrenditen
11 ↑5 ↓6		Gesamtportfolio 24 -3,6
kommende Quartalszahlen oder Fälligkeit (11)		!! WICHTIGE HINWEISE !!
NVIDIA Corporation Termin: 20.11.2024		Die Strategie ist noch nicht praxis-erprobt, weil sie ausschließlich auf Back-Tests beruht und muss noch justiert und verbessert werden.
VIX Dec17'2024 25 CALL Termin: 18.12.2024		Die Trades blind nachzuhandeln, ohne zu verstehen, was im Einzelnen die entscheidungsrelevanten Gründe für Kauf und Verkauf sind, wird ausdrücklich nicht empfohlen!
Bank OZK Termin: 16.01.2025		Die Auswahl der Aktion:
Ameriprise Financial, Inc. Termin: 22.01.2025		1. subjektive Auswahl der Aktien im Monats-Chart - 5 bis 10 Jahre LURO bevorzugt, Ausnahmen zulässig
SEI Investments Company Termin: 22.01.2025		2. Filterung der Aktien nach RSL 21, RSL 50 und einem selbst ermittelten Dynamik-Ranking
Eagle Materials Inc		3. 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. 7. Nov. 12:11:54

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

Konten

Konto	Kontostand	Währung	Notiz
Cash	0,99 USD		

Cash

Umsätze Kontosaldenverlauf

Datum	Transaktion	Symbol	Stück	Orderkurs	Order-Betrag	Gebühren	Rest-Saldo	Cash	Notiz
06.11.2024, 22:00	Kauf	ARES	5,6	172,14	-960,29	1,00	0,99		Fortsetzung Aufwärtstrend
06.11.2024, 22:00	Kauf	ODFL	4,2	229,70	-960,29	1,00	961,28		Fortsetzung Aufwärtstrend
06.11.2024, 22:00	Kauf	PH	1,4	707,98	-960,29	1,00	1.921,57		Fortsetzung Aufwärtstrend
06.11.2024, 22:00	Kauf	SEIC	12	79,86	-960,29	1,00	2.881,86		Fortsetzung Aufwärtstrend
06.11.2024, 22:00	Kauf	DOV	4,7	202,14	-960,29	1,00	3.842,15		Fortsetzung Aufwärtstrend
06.11.2024, 22:00	Kauf	TROW	7,9	121,06	-960,29	1,00	4.802,44		Fortsetzung Aufwärtstrend
06.11.2024, 22:00	Kauf	AMP	1,7	566,25	-960,29	1,00	5.762,73		Fortsetzung Aufwärtstrend
06.11.2024, 22:00	Kauf	EXP	3,1	312,11	-960,29	1,00	6.723,02		Fortsetzung Aufwärtstrend
06.11.2024, 22:00	Kauf	OZK	19,5	49,23	-960,29	1,00	7.683,31		Fortsetzung Aufwärtstrend
06.11.2024, 22:00	Kauf	NVDA	6,6	145,31	-960,29	1,00	8.643,60		Fortsetzung Aufwärtstrend
31.10.2024, 19:04	Verkauf	AMP	2	513,85	1.039,74	1,00	9.603,89		Verkaufsstindruck
31.10.2024, 19:04	Verkauf	SWK	9,4	93,39	874,12	1,00	8.564,15		Verkaufsstindruck
31.10.2024, 19:03	Verkauf	ARES	6,3	168,57	1.063,75	1,00	7.690,03		Verkaufsstindruck
31.10.2024, 19:03	Verkauf	APO	7,2	143,59	1.038,31	1,00	6.626,28		Verkaufsstindruck
31.10.2024, 19:03	Verkauf	EXP	3,4	285,09	970,53	1,00	5.587,97		Verkaufsstindruck
31.10.2024, 19:03	Verkauf	QCOM	5,9	162,47	952,52	1,00	4.617,44		Verkaufsstindruck
31.10.2024, 19:03	Verkauf	IBP	4,2	217,81	905,79	1,00	3.664,92		Verkaufsstindruck
31.10.2024, 19:03	Verkauf	TROW	8	109,63	881,48	1,00	2.759,13		Verkaufsstindruck
31.10.2024, 18:59	Verkauf	NVDA	7,5	132,97	1.000,41	1,00	1.877,65		Verkaufsstindruck
31.10.2024, 18:58	Verkauf	CAVA	7,6	133,74	1.012,24	1,00	877,24		Verkaufsstindruck
30.10.2024, 14:33	Kauf	VIX241218C00025000	100	1,34	-135,00	1,00	-135,00		Absicherung wg. möglicher hoher Volatilität zu den Präsidenten
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

*** 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.

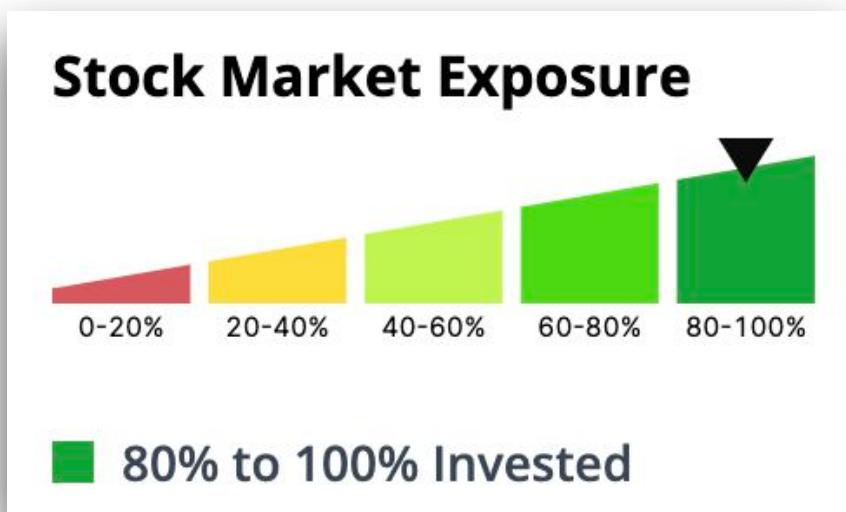
Im Gegenzug ist es einfacher und mit weniger Risiko verbunden, wenn man einen Aufwärtstrend im Gesamtmarkt für den Kauf einzelner Aktien nutzt (Rückenwind).

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! 🤘