

US-Markets - The Big Picture & Strategies

Freitag, 15. November 2024

Rote Vorzeichen gestern marktweit an der Wall Street. Die Indices gingen mit leichten bis soliden Verlusten aus dem Handel. Der RUT führte die Verlierer an.

Umsatzvolumen NASDAQ: gegenüber Vortag

gegenüber Durchschnitt

Umsatzvolumen NYSE: gegenüber Vortag

gegenüber Durchschnitt



(Quelle: finviz.com)

FED-Chef Jerome Powell teilte gestern in seiner Rede mit, dass die FED mit weiteren Zinssenkungen keine Eile hat und erst einmal die Politik von Donald Trump abwartet. Der Kauflaune hat es geschadet und die Aktien weiter unter Druck gesetzt.

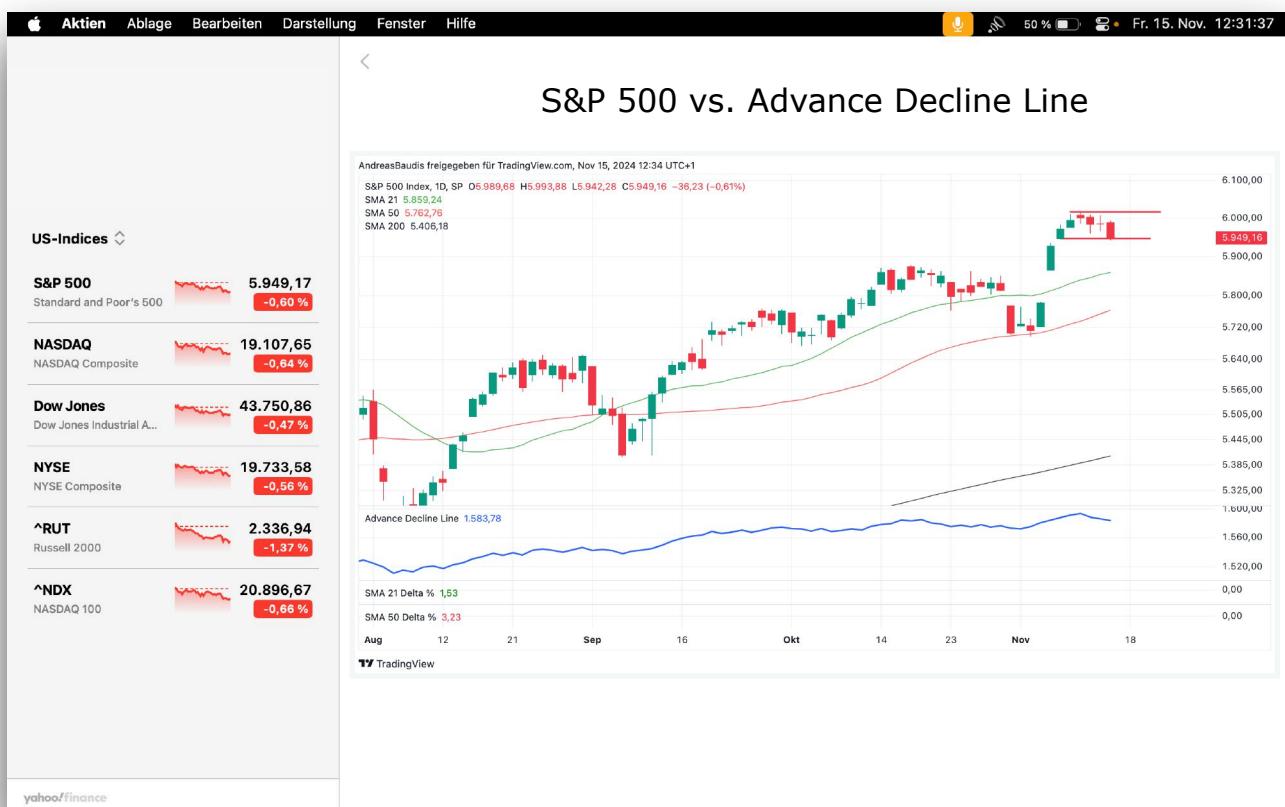
Der Gesamt-Markt befindet sich weiterhin im Aufwärtstrend, bekommt aber zunehmend Druck. Positionen reduzieren, Stopps näher an den Kurs heranziehen und/oder keine neuen Positionen eröffnen könnte helfen, das Risiko nicht unnötig zu erhöhen.

Ausblick: unklar, bestenfalls seitwärts

Bedingungs-Order für die Index-Strategien:

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

StopLoss bei einem SPX-Kurs von: 5.712,50 (Sicherheitsstopp, wird täglich und ausschließlich nach oben nachgezogen)



Wichtige Termine USA heute:

15. November 2024			
Einzelhandelsumsatz m/m			
 –	0.0%	0.4%	Vorherige
14:30	Aktuell	Prognose	
Kern Verbraucherpreise m/m			
 –	0.3%	0.5%	Vorherige
14:30	Aktuell	Prognose	
Einzelhandelsumsätze m/m			
 –	0.5%	0.7%	Vorherige
14:30	Aktuell	Prognose	
NY Empire-State-Index des verarbeitenden Ge...			
 –	-4.5	-11.9	Vorherige
14:30	Aktuell	Prognose	
Fed, Industrieproduktion m/m			
 –	-0.2%	-0.3%	Vorherige
15:15	Aktuell	Prognose	
Fed Industrieproduktion y/y			
 –	0.2%	-0.6%	Vorherige
15:15	Aktuell	Prognose	
Lagerbestände der Hersteller, Einzel- und Gro...			
 –	0.2%	0.3%	Vorherige
16:00	Aktuell	Prognose	
Lagerbestände der Einzelhändler m/m			
 –	0.8%	0.8%	Vorherige
16:00	Aktuell	Prognose	

15. November 2024			
Lagerbestände der Einzelhändler exkl. Autos...			
 –	–	–	0.1%
16:00	Aktuell	Prognose	Vorherige
Baker Hughes Ölplattformzählung			
 –	–	–	479
19:00	Aktuell	Prognose	Vorherige
Baker Hughes US, Gesamtzahl der Ölförderanl...			
 –	–	–	585
19:00	Aktuell	Prognose	Vorherige
FOMC Mitglied Williams spricht			
 –	–	–	–
19:15	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
MNDY	ZETA	SHOP	SOUN	HUT	CSCO	DIS	AMAT	BABA	
monday.com	ZETA	shopify	SoundHound	HUT 8	CISCO	WarDisney	APPLIED MATERIALS	Alibaba Group	
ICL	GRAB	PLUG	MARA	CYBR	DLO	TLN	ASTS	AIM	
ICL	Grab	PLUG	MARATHON	CYBERARK	d-local	TALEN ENERGY	SpaceMobile	ImmunoTech	
aramark	LAZR	THE HIVE	CAVA	LQDA	KULR	LUNR	OKLO	Spectrum Brands	
LINC	LUMINAR	SE	Spotify	HIVE	BEAZER HOMES	INTUITIVE MACHINES	despegar	WISA	
LINCOLN TECH	LIVE NATION ENTERTAINMENT	ONON	OXY	TSEM	OptimizeRx	NICE	Post	Bio-Path Holdings	
GSL	ASSERTIO	Hertz	RKLB	stratasys	BNGO	Advanced Auto Parts	Globant	nexxen	
GLOBAL SHIP LEASE	ANGI HOME SERVICES	NVAX	BSEM	FULC	bionano GENOMICS	Auto Parts	ZEA		
NUWE	ASSURED GUARANTY	novavax	BioStem TECHNOLOGIES	Pulcrum Therapeutics	SuruMICRO SOFTWARE	Snow Good	INOVIO		
nuwellis	DOUBLE DOWN INNOVATIVE	Bitfarms	RKT	INVZ	Capricor	NetEase Games	iPOWER		
BMTH	Vaalco Energy	ALT	ROCKET Companies, Inc.	ARCO	TETRA TECH	OCUL	Ocular Therapeutics		
ROCKWELL MEDICAL	STAS	altimmune	WULF	BITM	H&P	ORIGIN	ORIGIN		
RDNT	CRONOS GROUP	CRON	TERAWULF	CART					
RadNet	STEREOTAXIS	instacart							
SPNS									
SAPIENS									
BRDCTY									
BRIDGESTONE									
STEREOTAXIS									
http://eps.sh/cal									

© 2024 Earnings Whispers

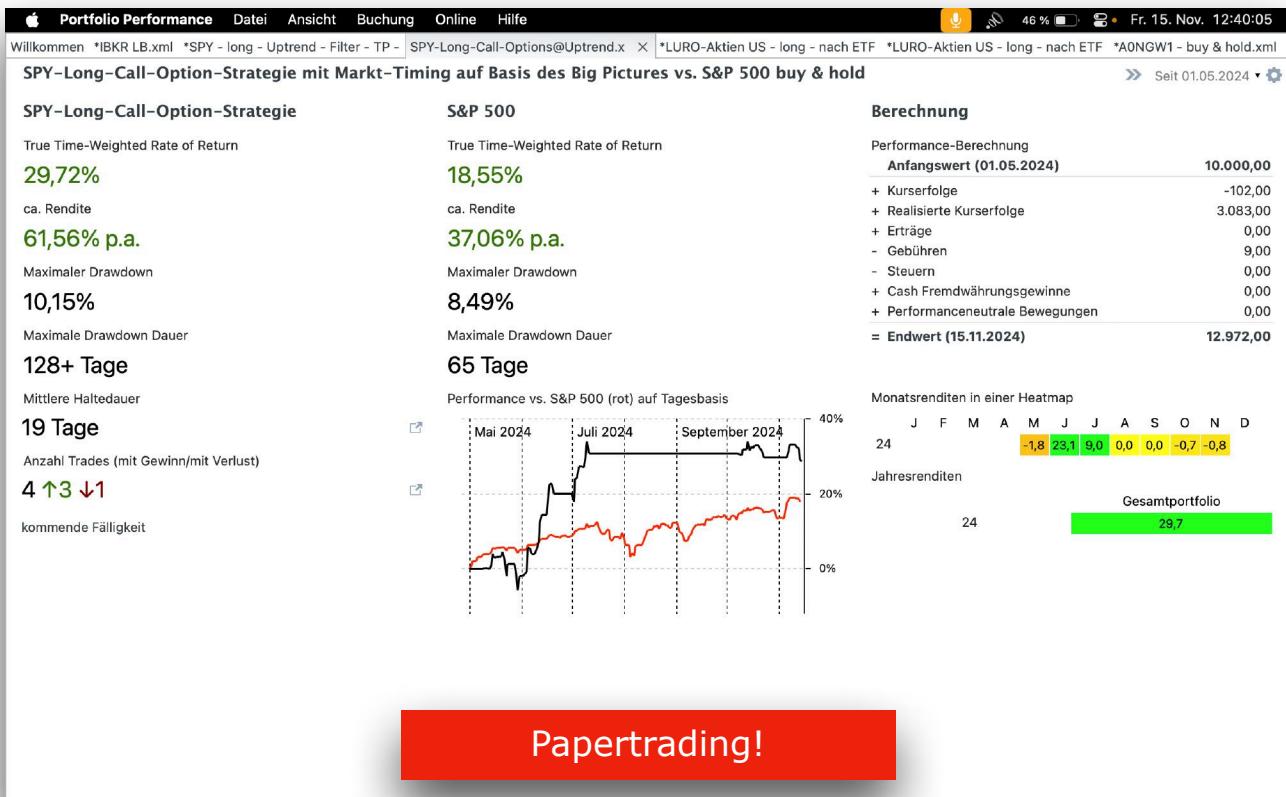
SPY-ETF-Strategie mit Markt-Timing auf Basis des Big Picture im Vergleich zu buy & hold im S&P 500 ab 01.02.2018. Für die ETF-Strategie sind zusätzliche Regeln für Gewinnmitnahmen und Verlustbegrenzung erforderlich. Die Strategie dient ausschließlich dem direkten Vergleich zwischen buy & hold und Markt-Timing.

Portfolio Performance		Datei	Ansicht	Buchung	Online	Hilfe	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	46 %	Fr. 15. Nov. 12:39:32
SPY-ETF-Strategie mit Markt-Timing auf Basis des Big Pictures vs. S&P 500 buy & hold														
➤ Seit 01.02.2018 ▾														
SPY-ETF-Strategie		S&P 500							Berechnung					
True Time-Weighted Rate of Return					True Time-Weighted Rate of Return					Performance-Berechnung				
135,76%					110,82%					Anfangswert (01.02.2018)				
ca. Rendite					ca. Rendite					10.000,00				
13,46% p.a.					11,61% p.a.					+ Kurserfolge				
Maximaler Drawdown					Maximaler Drawdown					91,79				
5,08%					33,92%					+ Realisierte Kurserfolge				
Maximale Drawdown Dauer					Maximale Drawdown Dauer					13.540,26				
265 Tage					746 Tage					+ Erträge				
Mittlere Haltedauer					Performance vs. S&P 500 (rot) auf Wochenbasis					- Gebühren				
25 Tage										- Steuern				
Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust)										+ Cash Fremdwährungsgewinne				
27 ↑20 ↓7										+ Performanceneutrale Bewegungen				
										= Endwert (15.11.2024)				
										23.576,00				
										Jahresrenditen				
										18				
										19				
										20				
										21				
										22				
										23				
										24				
										Gesamtportfolio				
										3,6				
										18,2				
										28,5				
										12,2				
										2,4				
										13,2				
										15,3				

Die letzten Transaktionen der SPY-ETF-Strategie.

Portfolio Performance									Datei	Ansicht	Buchung	Online	Hilfe	100 %	Do. 7. Nov. 11:12:59
Willkommen	IBKR LB.xml	*SPY - long - Uptrend - Filter - TP -	X	*SPY-Long-Call-Options@Uptrend.x	*LNUO-Aktien US - long - nach ETF	LNUO-Aktien US - long - nach ETF-	A0NGW1 - buy & hold.xml								
Konten															
Konto Kontostand Währung Notiz															
Cash		0,00	USD												
Cash															
<input type="checkbox"/> Umsätze	<input type="checkbox"/> Kontosaldenverlauf														
Datum	▼ Transaktion	Symbol	Stück	Orderkurs	Order-Betrag	Gebühren	Rest-Saldo	Cash	Notiz						
06.11.2024, 22:00	Kauf	SPY	39,7	591,04	-23.485,26	1,00	0,00		SPX close 0,5% ≥ SMA 21 uptrend resumes						
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 Vorlag, 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						
15.05.2024	Kauf	SPY	20,9	529,78	-11.085,70	1,00	0,00		FTD in NDQ						
09.05.2024	Kauf	SPY	21,3	520,17	-11.085,69	1,00	11.085,70		erstmalig Wechsel von Korrektur auf Verkaufsdruck; 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/t 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						

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.

The screenshot shows a transaction history table with the following columns:

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, 17:15	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	8.118,00		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 Verkaufsdruck; 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.

14.11.2024

Die LURO-Aktien-Strategie wird bis auf Weiteres nicht mehr aktualisiert. Hintergrund: ich habe zeitgleich zum Paper-Trading die Strategie auch im Echtgeld ausgeführt. Dabei haben sich verschiedene Hindernisse bei der Abwicklung gezeigt, die erst einmal beseitigt werden mussten. Außerdem wurden einige Änderungen in der Strategie selbst vorgenommen, so dass die Paper-Trading-Variante zwischenzeitlich deutlich von der Echtgeld-Variante abweicht.

Wahrscheinlich war der Zeitpunkt für die Veröffentlichung der Paper-Trading-Variante noch nicht der Richtige und wenn die Echtgeld-Variante stabil läuft, nehme ich ggfls. noch einmal einen neuen Anlauf hier.

*** 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! 🤘