

US-Markets - The Big Picture & Strategies

Donnerstag, 21. November 2024

Die Indices an der Wall Street bewegten sich gestern überwiegend unter der Null-Linie, konnten zum Handelsende die Verluste jedoch überwiegend wieder ausgleichen und beendeten den Tag mit leichten Verlusten bis leichten Gewinnen.

Umsatzvolumen NASDAQ: ↓ gegenüber Vortag

↑ gegenüber Durchschnitt

Umsatzvolumen NYSE: ↓ gegenüber Vortag

↓ gegenüber Durchschnitt



(Quelle: finviz.com)

Der SPX bewegt sich weiterhin in einer recht engen Bandbreite seitwärts. Da NVDA gestern nach Börsenschluß die Quartalszahlen bekannt gab, könnte es heute wieder etwas volatil werden.

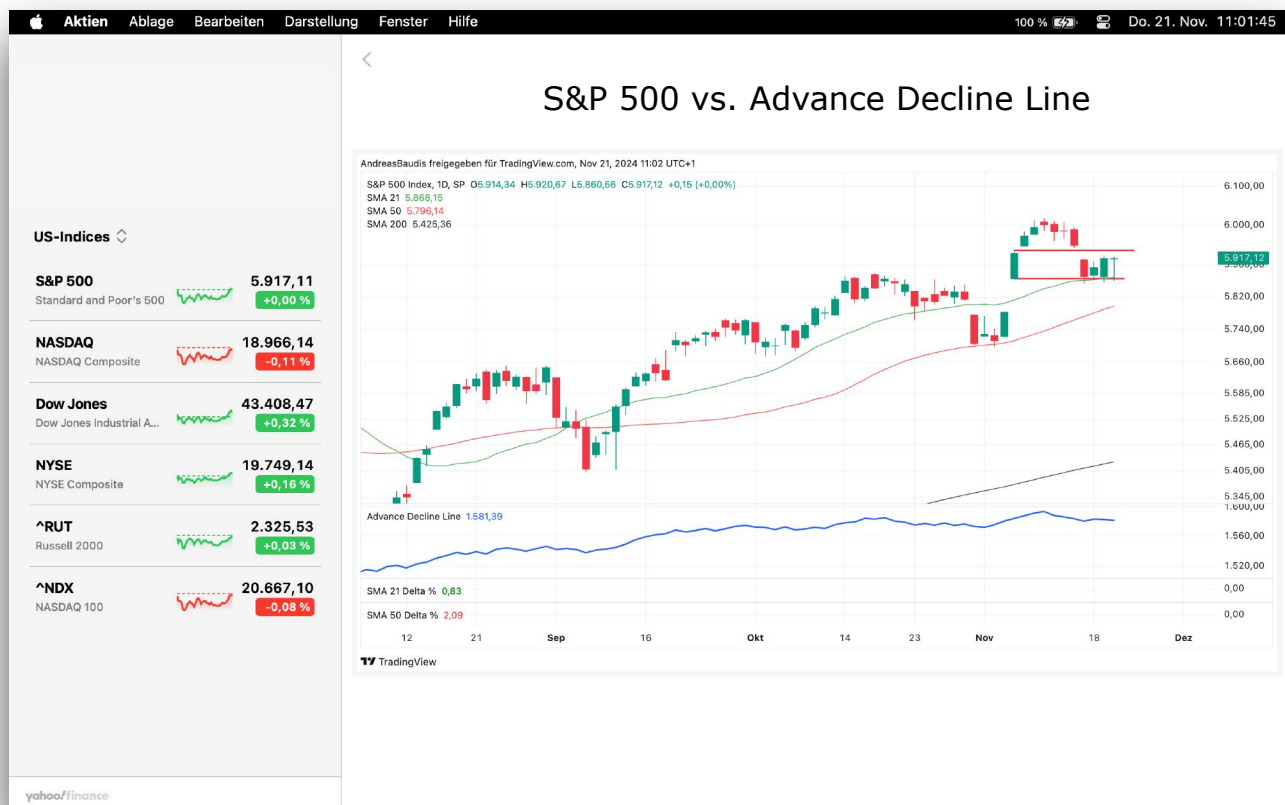
Für den Augenblick bleibt der Gesamt-Markt im Aufwärtstrend, aber das Eis ist noch immer dünn.

Ausblick: volatil, seitwärts, ohne klare Richtung







Bedingungs-Order für die Index-Strategien:

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

StopLoss bei einem SPX-Kurs von: 5.721,00 (Sicherheitsstopp, wird täglich und ausschließlich nach oben nachgezogen)



Wichtige Termine USA heute:

21. November 2024			
Philadelphia Fed Index der Unternehmer			
	–	7.1	10.3
14:30	Aktuell	Prognose	Vorherige
Philadelphia Fed, Beschäftigung			
	–	17.9	-2.2
14:30	Aktuell	Prognose	Vorherige
Erstanträge auf Arbeitslosenhilfe			
	–	217 K	217 K
14:30	Aktuell	Prognose	Vorherige
Tatsächliche Hausverkäufe			
	–	3.78 M	3.84 M
16:00	Aktuell	Prognose	Vorherige
Tatsächliche Hausverkäufe m/m			
	–	-2.7%	-1.0%
16:00	Aktuell	Prognose	Vorherige
Rede des Vizevorsitzenden für Aufsicht der Fe...			
	–	–	–
22:40	Aktuell	Prognose	Vorherige

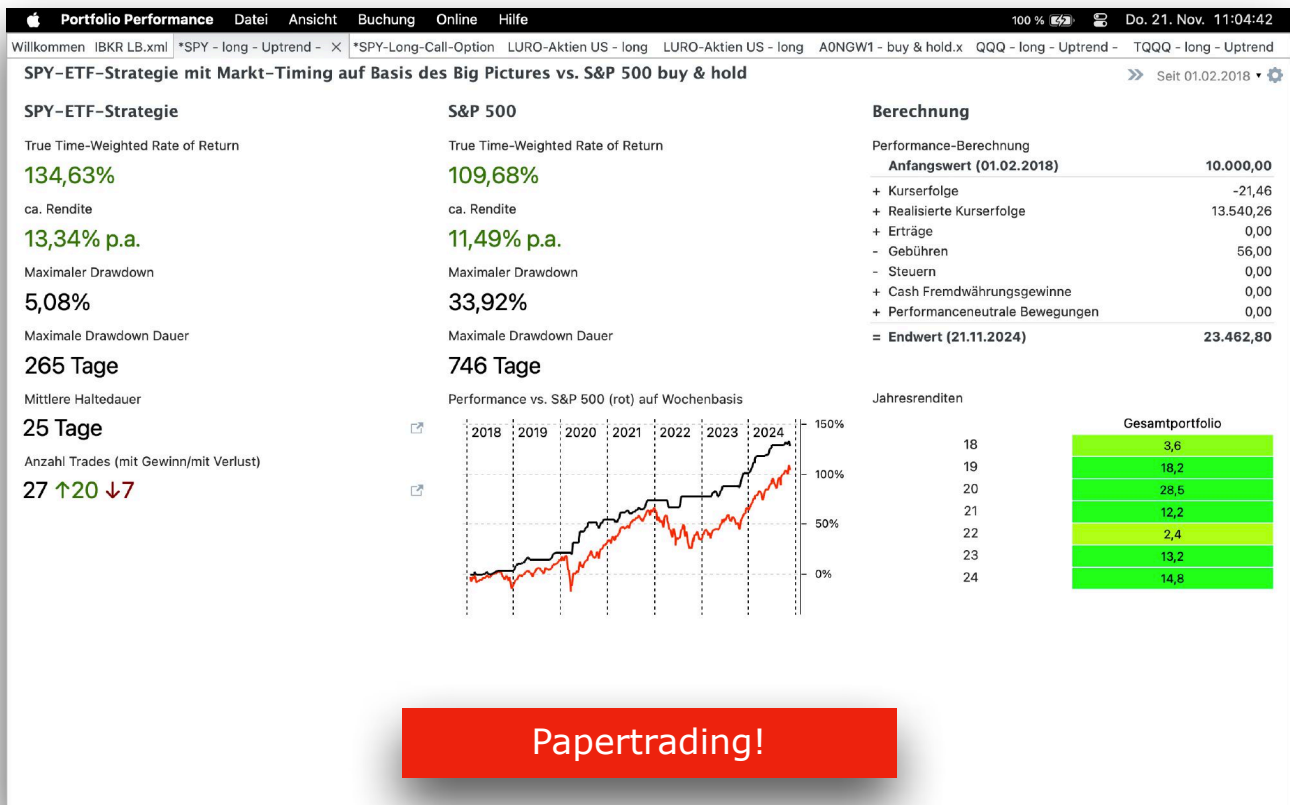
Die wichtigsten Quartalsergebnisse der Woche.

E EARNINGS WHISPERS		Most Anticipated Earnings Releases for the week beginning November 18, 2024							
Monday		Tuesday		Wednesday		Thursday		Friday	
Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	
BTBT BIT DIGITAL	SYM symbolic	WMT Walmart	POWL POWELL	NIO NIO	NVDA NVIDIA	BIDU Baidu	INTU Intuit	GB Global Blue	
BTDR BITDEER	TCOM Trip.com	WKHS WORKHORSE	AZEK THE AZEK COMPANY	TGT TARGET	SNOW snowflake	PDD Pinduoduo Inc.	ESTC elastic	ADN addex	
EH EHANG 亿航	BRBR belling	LOW Lowe's	KEYS KEYSIGHT TECHNOLOGIES	ZIM ZIM	PANW paloalto	PDD 拼多多	GAP Gap Inc.		
BRC BRADY	TUYA tuya	XPEV XPENG	ZTO ZTO 中通快递	TJX TJX	JACK Jack	JOHN DEERE JOHN DEERE	ROSS ROSS DRESS FOR LESS		
TWST T W I S T	ACM AECOM	MDT Medtronic	LZB LABOY	WIX WIX	CPA Copa Airlines	BIS Bis	NTAP NetApp		
MOND MONDEE	ZENV zenvia	FUTU FUTU	KORE KORE	DY DYCOM	SQM SQM	VST vestis	CPRT Copart		
CLRB COLLECTAR BIOSCIENCES	BIV VERTICALS	VIPS 唯品会 vip.com	DLB DOLBY	WSM WILLIAMS-SONOMA	MMS MAXIMUS	W WARNER MUSIC GROUP	UGI UGI CORPORATION		
	NRXP NRX	VK VIKING	DNMR danimer scientific	BERY Berry	CCF CARLYLE	BEKE 贝壳	UIG Matthews INTERNATIONAL		
		ATAT ATOUR GROUP	SBLK STAR BULK	GLBE Global e	ESEA EUROSEAS LTD	IQ 爱奇艺	NGVC NATURAL GROCERS		
		MYT MYTHERESA	QFIN 360 金融	RERE 万物新生 AIRENEW	EBAR BBVA	NNOX SHOE CARNIVAL	LGTY LGTY		

<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.



Die letzten Transaktionen der SPY-ETF-Strategie.

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

Konten

Konto

Kontostand

Währung

Notiz

Cash

0,00 USD

Cash

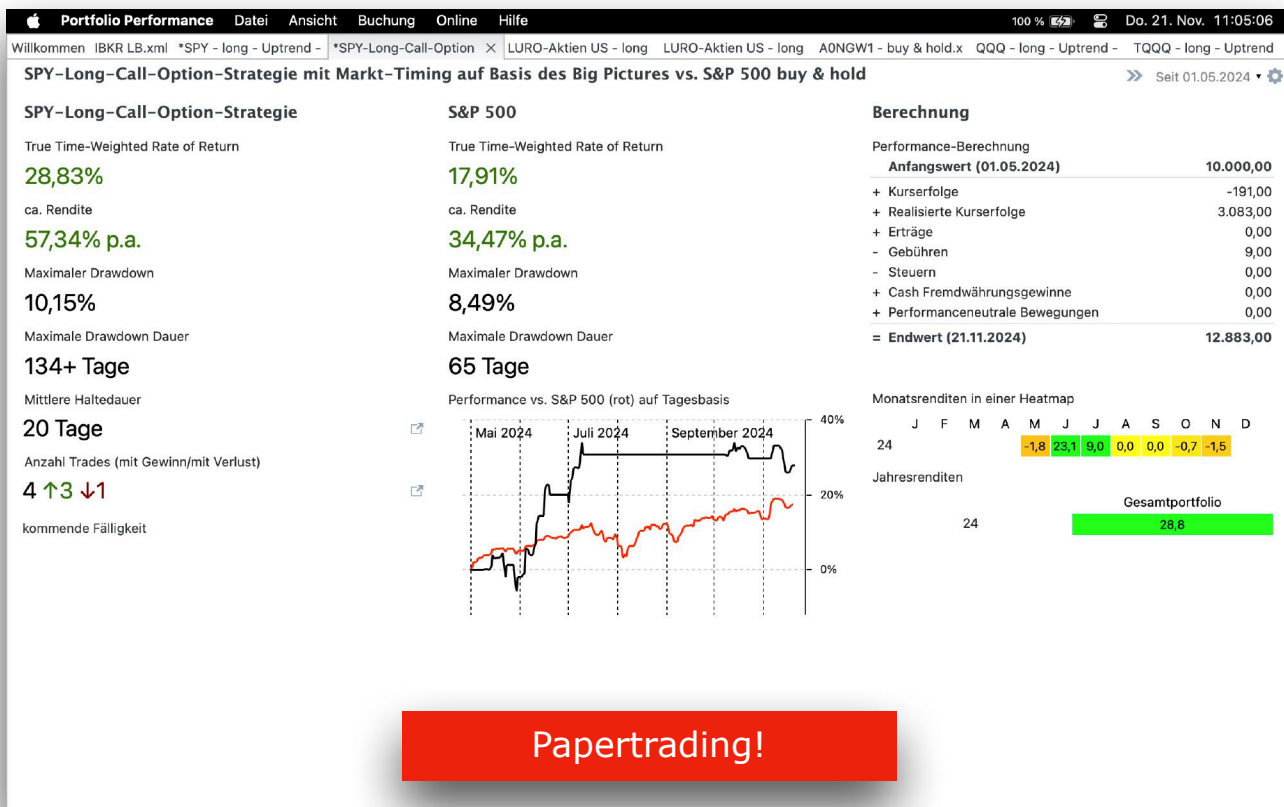
Umsätze

Kontosaldenverlauf

Suchen

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 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 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/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

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

100 %

Do. 7. Nov. 11:21:32

Willkommen

IBKR LB.xml

*SPY - long - Uptrend - Filter - TP -

*SPY-Long-Call-Options@Uptrend.x

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

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 können muss.

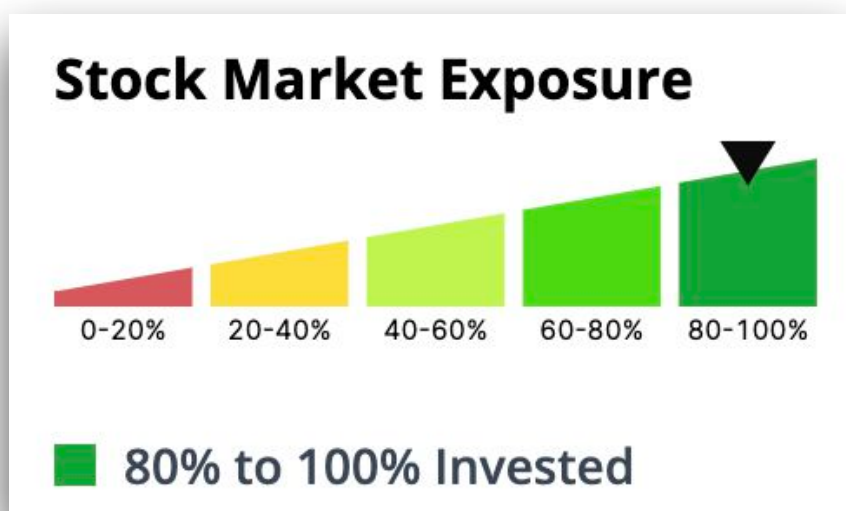
Im Gegenzug ist es einfacher und mit weniger Risiko verbunden, wenn man einen Aufwärtstrend im Gesamtmarkt für den Kauf einzelner Aktien nutzt (Rückenwind).

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! 👉