

US-Markets - The Big Picture & Strategies

Donnerstag, 5. Dezember 2024

Auch gestern setzte die Wall Street die Rekordjagd fort und die Indices verzeichneten leichte bis solide Tagesgewinne, allen voran erneut auch wieder die Technologiewerte.

Umsatzvolumen NASDAQ: gegenüber Vortag

gegenüber Durchschnitt

Umsatzvolumen NYSE: gegenüber Vortag

gegenüber Durchschnitt



(Quelle: finviz.com)

SPX, NDQ, DJIA und NDX erreichten neue ATHs auf Schlußkursbasis und der DJIA knackte zusätzlich noch die 45.000er Marke.

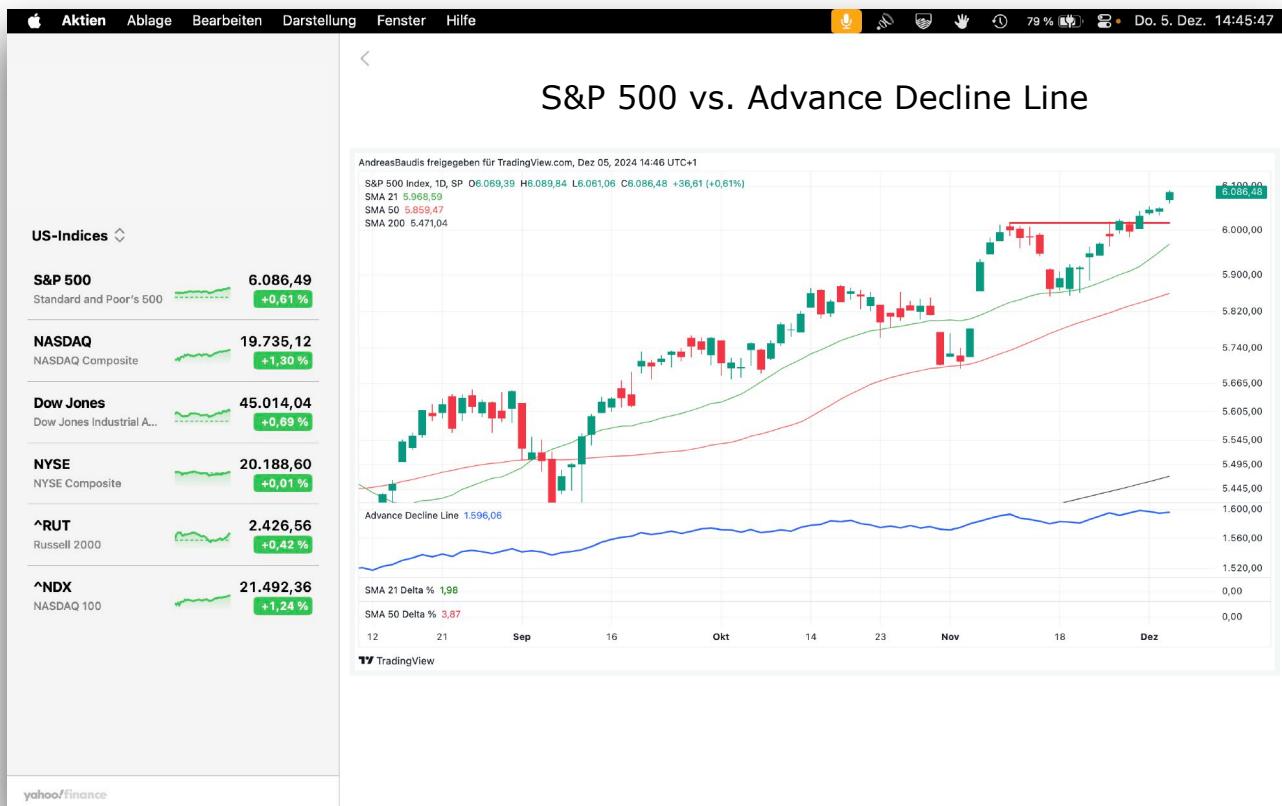
Der Gesamt-Markt bleibt im Aufwärtstrend, welcher sich weiter stabil präsentiert.

Ausblick: weiter leicht bis solide aufwärts

Bedingungs-Order für die Index-Strategien:

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

StopLoss bei einem SPX-Kurs von: 5.819,25 (Sicherheitsstopp, wird täglich und ausschließlich nach oben nachgezogen)



Wichtige Termine USA heute:

5. Dezember 2024			
Handelsbilanz			
 14:30	\$-73.836 B Aktuell	\$-77.201 B Prognose	\$-83.795 B Vorherige
Erstanträge auf Arbeitslosenhilfe			
 14:30	224 K Aktuell	205 K Prognose	215 K Vorherige

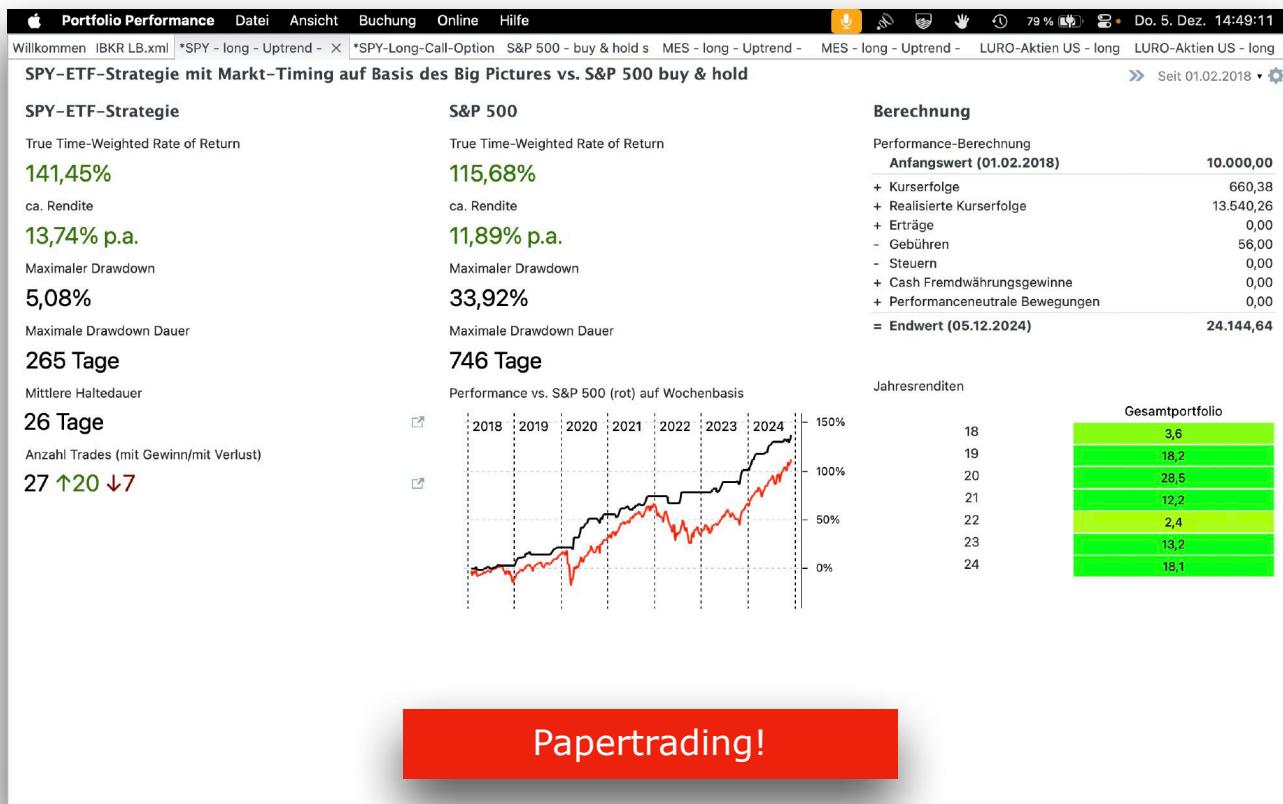
Die wichtigsten Quartalsergebnisse der Woche.

Most Anticipated Earnings Releases for the week beginning December 02, 2024									
Monday		Tuesday		Wednesday		Thursday		Friday	
Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	After Close	Before Open	
ZS zscaler		BNS Scotiabank		CRM salesforce		CHWY chewy		S SentinelOne	
CRDO CREDO		CNM CORE & MAIN		OKTA okta		FL Foot Locker		AEO AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	
DCL Donaldson		MVL MARVELL		DOLLAR TREE DOLLAR TREE		FIVE BELOW five BELOW		DG DOLLAR GENERAL	
REX BX American Resources Corporation		PSTG PURE STORAGE		RY RBC		SNPS SYNOPSIS		LULU lululemon	
DSQX Couchbase		CPB Campbell's		THOR THOR		CHPT chargepoint+		TD TD Bank	
DESCARTES		CBR Cracker Barrel Old Country Store		AVV AeroVironment		BMO SIGNET JEWELERS		PATH UiPath	
NOTV inotiv analyze. answer. advance.		DAKT Hormel Foods		NCNO ncino		GEF METHODE ELECTRONICS		ULTA ULTA BEAUTY	
SCWX DAKTRONICS		SEC Secureworks		VRNT GREIF		CAL CALERES		DOCU DocuSign	
				VERINT VERINT		KR Kroger		HPE GitLab	
						WOOF petco THE HEALTH + WELLNESS CO.		MEI Hewlett Packard Enterprise	
						ASAN asana		IOT samsara	
								VEEV veeva	
								CIBC CIBC	
									ASAN asana

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	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		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		- 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		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		% Tief davor im SPX						
08.01.2024	Kauf	SPY	43,1	474,60	-20.441,58	1,00	0,00		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		% 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		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		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		% 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		Rally 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.

Portfolio Performance Datei Ansicht Buchung Online Hilfe

Willkommen IBKR LB.xml *SPY - long - Uptrend - *SPY-Long-Call-Option X S&P 500 - buy & hold s MES - long - Uptrend - MES - long - Uptrend - LURO-Aktien US - long LURO-Aktien US - long

Do. 5. Dez. 14:49:20

SPY-Long-Call-Option-Strategie mit Markt-Timing auf Basis des Big Pictures vs. S&P 500 buy & hold

Seit 01.05.2024 ▾

SPY-Long-Call-Option-Strategie	S&P 500	Berechnung
True Time-Weighted Rate of Return 36,41%	True Time-Weighted Rate of Return 21,28%	Performance-Berechnung Anfangswert (01.05.2024) 10.000,00
ca. Rendite 68,18% p.a.	ca. Rendite 38,34% p.a.	+ Kurserfolge 567,00 + Realisierte Kurserfolge 3.083,00 + Erträge 0,00 - Gebühren 9,00 - Steuern 0,00 + Cash Fremdwährungsgewinne 0,00 + Performanceneutrale Bewegungen 0,00 = Endwert (05.12.2024) 13.641,00
Maximaler Drawdown 10,15%	Maximaler Drawdown 8,49%	
Maximale Drawdown Dauer 147 Tage	Maximale Drawdown Dauer 65 Tage	
Mittlere Haltedauer 23 Tage	Performance vs. S&P 500 (rot) auf Tagesbasis	Monatsrenditen in einer Heatmap
Anzahl Trades (mit Gewinn/mit Verlust) 4 ↑3 ↓1		J F M A M J J A S O N D 24 -1,8 23,1 9,0 0,0 -0,7 1,9 2,4 Jahresrenditen Gesamtportfolio 24 36,4
Kommende Fälligkeit (ⓘ) SPY Jan17'2025 595 Call Termin: 17.01.2025		

Papertrading!

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 X *LURO-Aktien US - long - nach ETF LURO-Aktien US - long - nach ETF- A0NGW1 - buy & hold.xml

Do. 7. Nov. 11:21:32

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, 17:15	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	8.818,00		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 Verkaufsdruck; daher nur 50% Pos
01.05.2024	Einlage				10.000,00		10.000,00		US-Markt in Korrektur

*** 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.

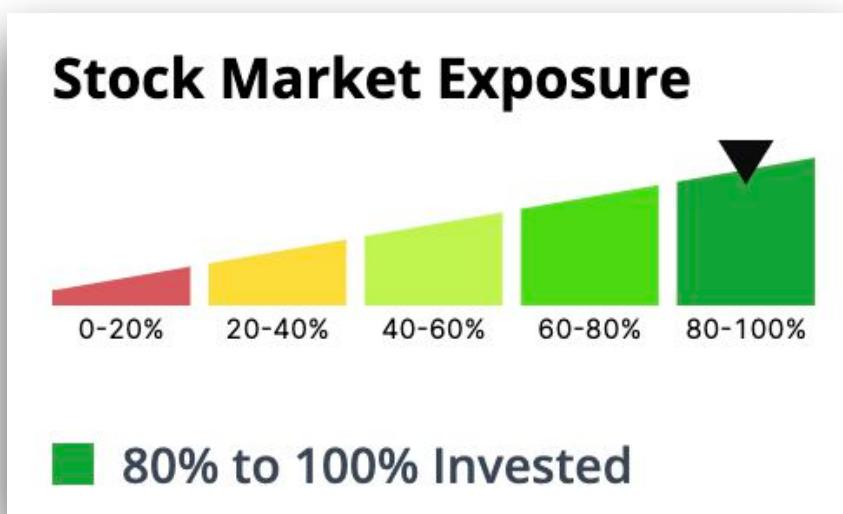
Im Gegenzug ist es einfacher und mit weniger Risiko verbunden, wenn man einen Aufwärtstrend im Gesamtmarkt für den Kauf einzelner Aktien nutzt (Rückenwind).

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! 🤘