

Monatsultimo (Handelsstrategie)

Das Regelwerk:

Kaufe in den Monaten Januar, Februar, März, April, Mai, Juni, Oktober, November und Dezember am 26. des jeweiligen Monats den S&P 500 zur Handelseröffnung um 15:30 Uhr (deutsche Zeit) und setze somit auf steigende Kurse. Sollte dieser Tag auf einen Feiertag oder ein Wochenende fallen, verschiebt sich der Kaufzeitpunkt auf den nächsten Handelstag. Die Position wird bis zum Ende des 5. Kalendertags des darauffolgenden Monats gehalten. Sollte der 5. Tag auf einen Feiertag oder am Wochenende fallen, verschiebt sich der Verkauf auf den vorherigen Handelstag. Du bist also maximal 10 Kalendertage investiert. Diese Strategie setzt du 9-mal im Jahr um. Nicht eingestiegen wird ich in den Monaten Juli, August und September.

Die Logik dahinter:

Gehaltszahlungen, Versicherungsprämien und Sparpläne werden meist zum Ultimo (Monatsende) angelegt. Diese Nachfrage nach Aktien treibt den Markt entsprechend hoch. Außerdem gibt es zu Quartals-abschlüssen häufig Window-Dressing. Strategische Unternehmens- und Anlageentscheidungen werden i.d.R. zwischen November und April getroffen, in dieser Zeit kommt es auch häufiger zu Firmenübernahmen. Mittelzuflüsse haben ein deutliches Minimum in den Sommermonaten und ziehen über die Wintermonate deutlich an. Die Nachrichtenfrequenz ist im Sommer geringer als im Winter (Sommerloch). Die Liquidität ist in den Sommermonaten ebenfalls geringer, da die Anzahl der Marktteilnehmer deutlich ausgedünnt ist.

Chart (Backtest):

