

Happy Money Signale Factsheet

- die Strategie besteht aus 5 Long-Only-Einzelsystemen, die zueinander unkorreliert sind, und einem Indexsystem, das im Fall einer negativen Entwicklung als Hedge eingesetzt wird
- Signale erfolgen wöchentlich am Wochenende, etwa 12 Signale monatlich
- 2024 im realen Handel hat das Metasystem 28 Prozent erbracht
- die errechnete Performance der letzten 10 Jahre beträgt jährlich mehr als 27 Prozent (nicht im Realhandel und mit Zinseszinsseffekt erreicht, also thesaurierend)
- die Schwankungen sind gering und der erwartete maximale Drawdown ist geringer als 20 Prozent
- die Metastrategie lässt sich mit einem Konto von mindestens 15.000 € umsetzen
- es werden hauptsächlich amerikanische Bluechip- Aktien gehandelt

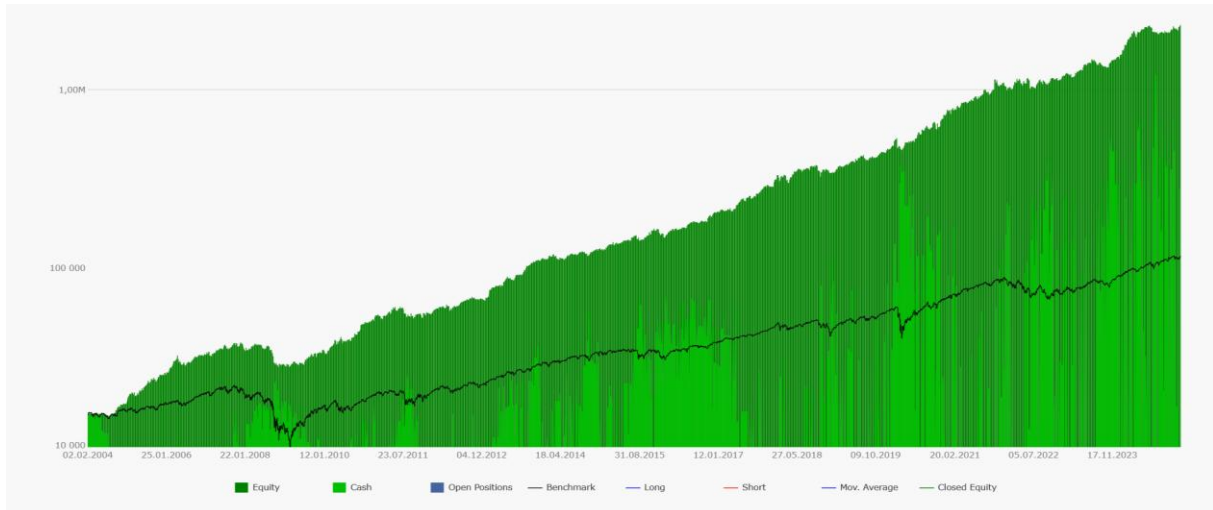
Haftungsausschluss:

Zukünftige Entwicklungen lassen sich nicht direkt aus den Ergebnissen der Vergangenheit ableiten, historische Gewinne lassen nicht unmittelbar auf Gewinne in der Zukunft schließen. Die Handelssysteme wurden mit größter Sorgfalt erstellt, backgetestet und optimiert. In der Zusammenstellung wurden sie 2024 real gehandelt, manche Systeme sind schon jahrelang mit geringen Änderungen in den Parametern und Portfolios erfolgreich im Einsatz.

Die vermittelten Signale sind genereller Natur und berücksichtigen nicht die individuellen Bedürfnisse von AnlegerInnen hinsichtlich Ertrag, steuerlicher Situation, Risikobereitschaft oder Geeignetheit der Finanzprodukte. Sie ersetzen weder eine anleger- und objektgerechte Beratung, noch eine umfassende Risikoaufklärung.

Geschäfte mit Finanzprodukten können riskant sein (z. B. Aktien, ETFs und andere), sogar ein Totalverlust des eingesetzten Kapitals kann nicht ausgeschlossen werden. Die Informationen stellen weder eine Anlageberatung oder -empfehlung dar, noch ein Angebot, eine Empfehlung oder Einladung zum Kauf oder Verkauf der genannten Finanzprodukte bzw. deren Einbeziehung in eine Trading-Strategie. Es wird lediglich ermöglicht, Handelssignalen zu folgen. Es wird keinerlei Haftung für unmittelbare oder mittelbare Schäden übernommen, die durch die Verwendung dieser Webseite verursacht werden könnten.

Factsheet Happy Money



Systemkennzahlen, 10 Jahre backgetestet mit Wealth Lab

Summary	
ProfitPct	15094,92
APR	27,05
SharpeRatio	1,59
Alpha (α)	25,11
WL Score	21,15
Exposure	92,89
APR (IS)	23,17
APR (OS)	34,21
ProfitFactor	2,84
AvgTradesPerMonth	13,00
PositionCount	1638,00
NSF Position Count	14169,00
Avg Profit %	10,00
Average Drawdown %	-3,60
Percent New Highs	11,14
Time @ DD 5%	25,65
Time @ DD 10%	8,72
Time @ DD 20%	2,94
MaxDrawdownPct	-27,40
Commission Paid	6904,00
Dividends Received	85712,32
Expected Drawdown %	-17,67
System Quality	15,31

Monatliche Performance 2014-2024:

Year	Jän	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Annual	Benchmark Spy	
2004			0	0,04	-0,11	1,34	-1,31	-2,06	1,13	1,48	7,62	3,88	1,79	14,32	6,46
2005	8,07	4,24	-0,14	-0,79	5,31	3,9	5,99	2,27	5,46	-2,05	5,68	-0,92	43,19	4,78	
2006	4,43	7,24	7,22	4,58	-3,92	-1,66	-1	1,66	3,74	2,96	1,63	0,31	30,03	15,81	
2007	3,68	-3,55	1,75	5,84	1,67	-1,05	1,01	0,23	4,58	1,95	-1,2	-3,94	11	5,09	
2008	-0,61	-0,75	3,37	2,66	-1,2	-4,38	1	-0,02	-10,44	-7,86	-1,86	0	-19,12	-36,7	
2009	-2,08	-1,63	5,3	-0,52	-0,79	-0,34	5,46	3,69	0,48	0,74	4,93	3,19	19,56	26,22	
2010	-4,85	3,8	6,29	7,77	-0,31	-3,1	4,11	3,47	3,86	13,35	2,06	1,54	43,61	15,02	
2011	8,66	-0,78	1,57	2,16	7,63	-0,66	-5,79	-5,06	-1,46	5,25	1	0,65	12,78	1,89	
2012	2,49	2,65	3,65	-0,42	-4,16	4,81	5,04	3	3,96	-2,39	0,51	0,84	21,37	15,87	
2013	10,7	4,46	-0,71	9,3	2,35	0,55	5,23	5,62	6,61	4,8	1,1	2,22	65,73	32,19	
2014	0,79	4,67	-5,03	0,79	3,31	2,61	-2,14	4,81	-2,81	1,72	4,27	-1	12,07	13,39	
2015	3,18	4,46	0,72	0,45	3,42	0,54	5,87	-5,57	2,09	8,8	4,74	-1,17	30,33	1,23	
2016	-9,49	6,79	4,28	-0,98	2,55	2,55	4,23	0,82	2,23	-2,4	7,6	5,85	25,35	11,94	
2017	2,73	-0,13	2,09	0,39	10	0,77	6,09	-0,08	5,03	7,25	0,65	5,2	47,38	21,62	
2018	6,13	1,19	-7,13	11,22	4,85	0,23	2,5	3,87	-0,5	-7,79	4,52	-5,59	12,36	-4,58	
2019	3,91	6,09	0,69	4,1	-0,2	6,93	-1,35	0,76	-0,09	2,92	3,17	4,01	35,26	31,1	
2020	6,08	-0,59	-3,09	7,34	2,98	6,95	7,22	3,49	-0,11	4,58	7,3	5,83	59,02	18,23	
2021	6,21	0,32	4,57	5,01	1,73	5,82	0,77	8,67	-6,7	22,04	-8,44	3,08	48,25	28,65	
2022	-4,26	1,69	6,8	-0,2	4	-10,91	5,69	-2,36	-0,68	9,68	-0,47	1,9	9,63	-18,11	
2023	4,3	-0,88	2,22	3,65	7,2	2,23	1,28	-1,53	-4,25	3,44	5,02	0,89	25,64	26,06	
2024	14,83	12,06	11,44	-0,96	3,08	3,84	-5,45	-3,69	2,83	-1,52	5,02	-0,4	46,64	24,82	
2025	5,26												5,26	3,72	

Fragen und Antworten:

Mit welchem Broker werden die Signale umgesetzt?

Die Signale werden mit dem amerikanischen Broker „Interactive Brokers“ gehandelt. Es ist auch möglich, sie mit einem europäischen Introducing Broker von IB umzusetzen, wie Captrader oder WH SelfInvest. Die Gebühren sind m. E. günstig und die Ausführungen sind fair.

Wie kann man starten?

Zuerst ist ein Konto bei einem oben genannten Broker zu eröffnen. Nur dort können exakt die Aktien und ETFs gehandelt werden, die die verschiedenen Portfolios der Handelssysteme enthalten. Die Handelsplattform wird vom Broker beigestellt („Trader Workstation“). Beim Start ist es empfehlenswert, nur die Signale zu handeln, die ab dem Zeitpunkt des Starts vermittelt werden, außer der Kurs eines früheren Signals ist dem aktuellen Kurs noch sehr nahe.

Welche Kontogröße ist erforderlich?

Ein ungehebeltes Konto ist mit 15.000 € mindestens zu kapitalisieren. Die Kontogröße für den Start kannst du im Excelsheet ändern, sodass die enthaltene Positionsgrößenberechnung deiner Kontogröße entspricht.

Wie lange ist es sinnvoll, das System zu handeln?

Die Signale bekommst du für ein Jahr. Kürzer hat es keinen Sinn, wegen den Schwankungen und kurzfristigen Drawdowns, die vorkommen können.

Wann werden die Signale geschickt?

Du bekommst die Signale in einem Excel-Sheet wöchentlich bis spätestens vor dem Handelsstart montags zum Download von der Homepage.

Gibt es Echtgelddepots, in denen man das Ergebnis nachvollziehen kann?

Die Strategien wurden auf verschiedenen Konten gehandelt, dort aber auch andere Investitionen, daher lässt sich das nicht eindeutig präsentieren. Die Ergebnisse der 10-Jahres-Performance wurden durch die Backtestingsoftware Wealth-Lab vorgenommen. Für 2024 wurde die Performance der in der Metastrategie enthaltenen Systeme aufgrund eines Tradingtagebuchs errechnet.

Sind Unterschiede in der Performance zu erwarten?

Die Ausführungskurse und Spreads der Broker sind unterschiedlich, also kann es zu Abweichungen kommen.