



— QUANTITATIVE INVESTMENT SOLUTIONS —

BTC-ETH BREAKOUT | PORTAFOLIO DINÁMICO



ENFOQUE QUANTIC - CRYPTO

La principal característica del portafolio es la utilización de únicamente las 2 estrategias con mayor robustez y por tanto mayor probabilidad de éxito en el futuro.

La premisa detrás de esta estrategia es que los grandes saltos de precios a corto plazo tienden a ser precursores de movimientos adicionales en la misma dirección

ESTRATEGIA DE INVERSION

Seleccionamos las estrategias con mayor robustez y exposición a los 2 activos con mayor capitalización, BTC y ETH

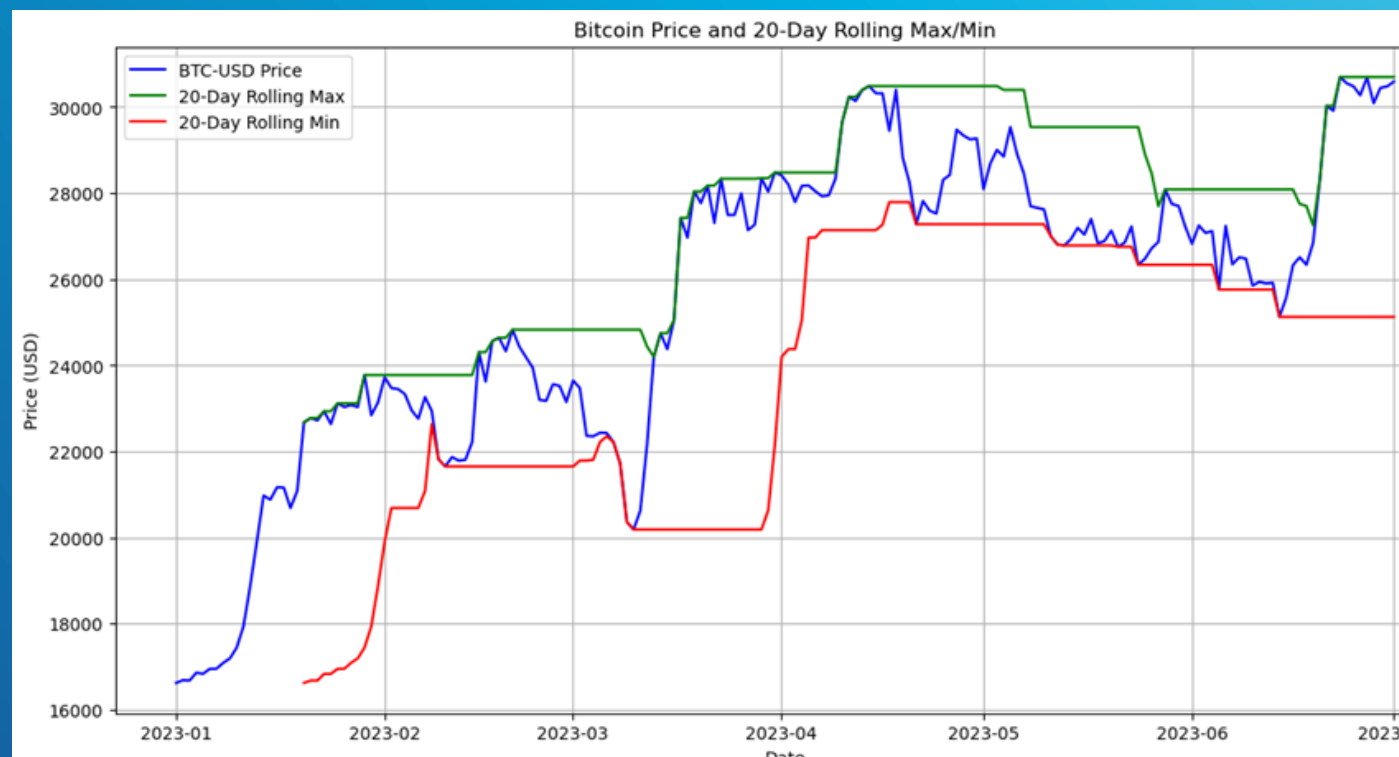


Channel Breakouts: Ruptura de canales

Los "breakouts" de canal obtienen su nombre de los canales que se crean al trazar un recuento continuo de los máximos más altos y mínimos más bajos durante un intervalo fijo de días. Un canal de 20 días implica calcular y trazar el cierre más alto y más bajo durante los últimos 20 días

Señales de compra y venta

Las entradas se ejecutan cuando los precios penetran el canal. Se realiza una compra cuando el cierre de hoy es mayor que los cierres previos x días, y se realiza una venta cuando el cierre de hoy es menor que los cierres de los días previos x. Cuanto más largo sea el canal, menos frecuentemente operará la estrategia



Quantic - BTC 20 Day high low rolling plot

ROBUSTEZ

Las estrategias seleccionadas tienen un periodo de observación largo y únicamente 2 condiciones de compra, lo que las convierte en unas estrategias sólidas y con una alta probabilidad de seguir desempeñándose de forma estable en el futuro.

METRICAS ESTRATEGIA BITCOIN



 2015-2024	METRICS	
METRIC	BITCOIN	QUANTIC BITCOIN BREAKOUT
Ann. Return	76.9%	97.5%
Ann Volatily	59.0%	28.9%
Max Drawdown	-83.4%	-22.0%
Sharpe Ratio (R/V)	1.30	3.4
Calmar Ratio (R/ MD)	0.92	4.4
Correlation	100%	49%
Positive Months	54.0%	61%
Min Month	-38.0%	-12%
Average Month	7.1%	6.6%
TIME IN MARKET	100%	24.0%

CALENDAR YEAR RETURNS			MONTHLY RETURNS											
	QUANTIC BITCOIN BREAKOUT	BITCOIN	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec
2015	91.9%	34.5%	0.0%	0.0%	8.9%	0.0%	0.0%	1.6%	2.5%	0.0%	0.0%	29.8%	20.8%	7.9%
2016	82.9%	123.8%	0.0%	3.0%	-2.5%	1.2%	12.1%	24.7%	0.0%	0.0%	1.2%	7.4%	-3.7%	22.9%
2017	721.5%	1368.9%	5.2%	11.4%	3.5%	5.7%	49.2%	7.3%	-8.7%	42.7%	-2.6%	26.9%	43.5%	73.2%
2018	-3.6%	-73.6%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	2.0%	-4.1%	0.0%	-1.5%	0.0%
2019	79.8%	92.2%	0.0%	-4.2%	-0.7%	19.8%	21.4%	25.9%	0.0%	3.2%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
2020	129.2%	303.2%	-3.5%	0.6%	0.0%	16.2%	0.8%	-6.4%	18.5%	-5.2%	0.0%	19.3%	23.8%	29.7%
2021	99.7%	59.7%	22.2%	29.6%	-3.6%	-0.6%	-1.1%	0.0%	21.1%	-2.9%	-6.6%	26.1%	-4.0%	0.0%
2022	5.2%	-64.3%	0.0%	0.0%	5.9%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.5%	0.0%	1.7%	-2.8%	0.0%
2023	84.6%	155.4%	33.9%	-0.8%	13.5%	-2.0%	-3.2%	7.2%	-3.8%	0.0%	0.0%	21.0%	-2.6%	6.2%
2024	26.5%	59.7%	-11.9%	29.1%	12.9%	-3.6%	2.2%							

Métricas: Las métricas presentadas se calculan utilizando datos diarios como referencia

Comisiones: Todos los resultados, métricas y backtest incluyen las comisiones de 0.25% por operación.

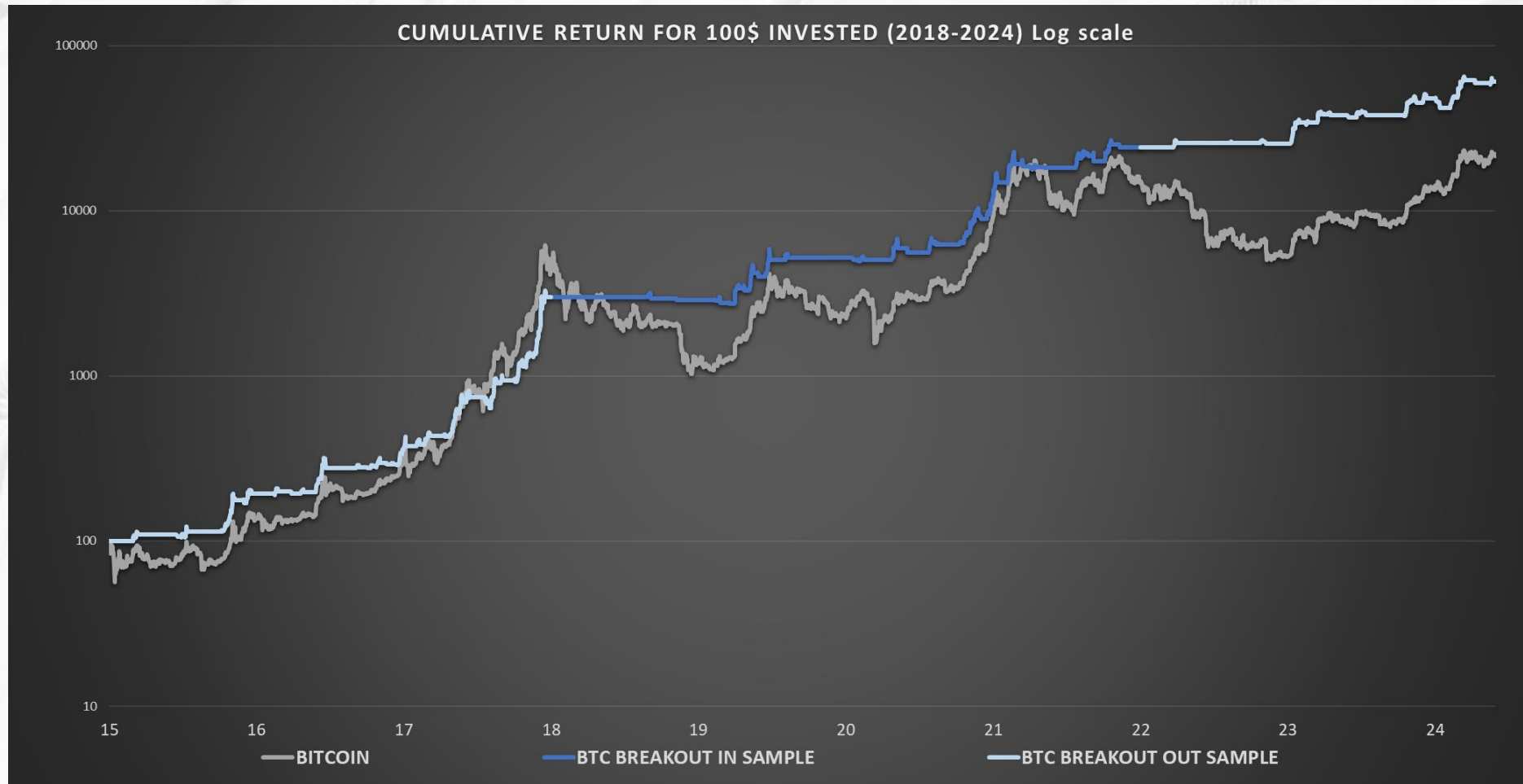
Data: El análisis se realizó utilizando datos diarios OHLCV (O: Apertura, H: Máximo, C: Cierre, V: Volumen). Los datos históricos (Febrero de 2015 - 29 Mayo de 2024) en intervalos diarios fueron descargados de Yahoo Finance

Los resultados de este backtest se basan en datos históricos y pueden no reflejar condiciones futuras del mercado. Se recomienda realizar una evaluación independiente antes de tomar decisiones de inversión.

La información proporcionada en este backtest no constituye asesoramiento financiero ni recomendaciones de inversión.



METRICAS ESTRATEGIA BITCOIN



Métricas: Las métricas presentadas se calculan utilizando datos diarios como referencia

Comisiones: Todos los resultados, métricas y backtest incluyen las comisiones de 0.25% por operación.

Data: El análisis se realizó utilizando datos diarios OHLCV (O: Apertura, H: Máximo, C: Cierre, V: Volumen). Los datos históricos (Febrero de 2015 - 29 Mayo de 2024) en intervalos diarios fueron descargados de Yahoo Finance

Los resultados de este backtest se basan en datos históricos y pueden no reflejar condiciones futuras del mercado. Se recomienda realizar una evaluación independiente antes de tomar decisiones de inversión.

La información proporcionada en este backtest no constituye asesoramiento financiero ni recomendaciones de inversión.



METRICAS ESTRATEGIA ETHEREUM



2018-2024	METRICS	
METRIC	ETHEREUM	QUANTIC ETH BREAKOUT
Ann. Return	27.5%	97.1%
Ann Volatily	74.1%	37.7%
Max Drawdown	-94.0%	-32.2%
Sharpe Ratio (R/V)	0.4	2.6
Calmar Ratio (R/ MD)	0.3	3.0
Correlation	100%	51%
Positive Months	50.0%	67%
Min Month	-54.0%	-19%
Average Month	5.7%	6.7%
TIME IN MARKET	100%	28.0%

CALENDAR YEAR RETURNS			MONTHLY RETURNS											
	QUANTIC ETH BREAKOUT	ETHEREUM	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec
2018	79.2%	-82.4%	54.0%	0.0%	0.0%	22.7%	-10.9%	0.0%	-10.3%	0.0%	0.0%	0.0%	-1.5%	20.4%
2019	32.9%	-2.8%	-10.5%	-2.4%	-6.3%	12.3%	34.4%	6.1%	0.0%	-10.4%	14.6%	0.0%	-1.3%	0.0%
2020	357.0%	469.2%	25.3%	52.1%	0.0%	27.0%	7.1%	-1.2%	28.8%	25.6%	-19.6%	0.1%	42.3%	-3.6%
2021	246.6%	399.1%	20.4%	17.3%	-5.5%	15.2%	31.2%	0.0%	10.1%	23.2%	9.4%	17.9%	-1.7%	0.0%
2022	14.7%	-67.5%	0.0%	1.0%	10.1%	7.3%	0.0%	0.0%	19.4%	-4.1%	2.3%	10.2%	-15.3%	-12.1%
2023	41.8%	90.6%	20.7%	-11.3%	5.4%	13.4%	-2.2%	3.7%	-9.9%	0.0%	0.9%	5.0%	10.7%	3.4%
2024	25.2%	61.9%	3.1%	28.6%	5.4%	-12.5%	2.4%							

Métricas: Las métricas presentadas se calculan utilizando datos diarios como referencia

Comisiones: Todos los resultados, métricas y backtest incluyen las comisiones de 0.25% por operación.

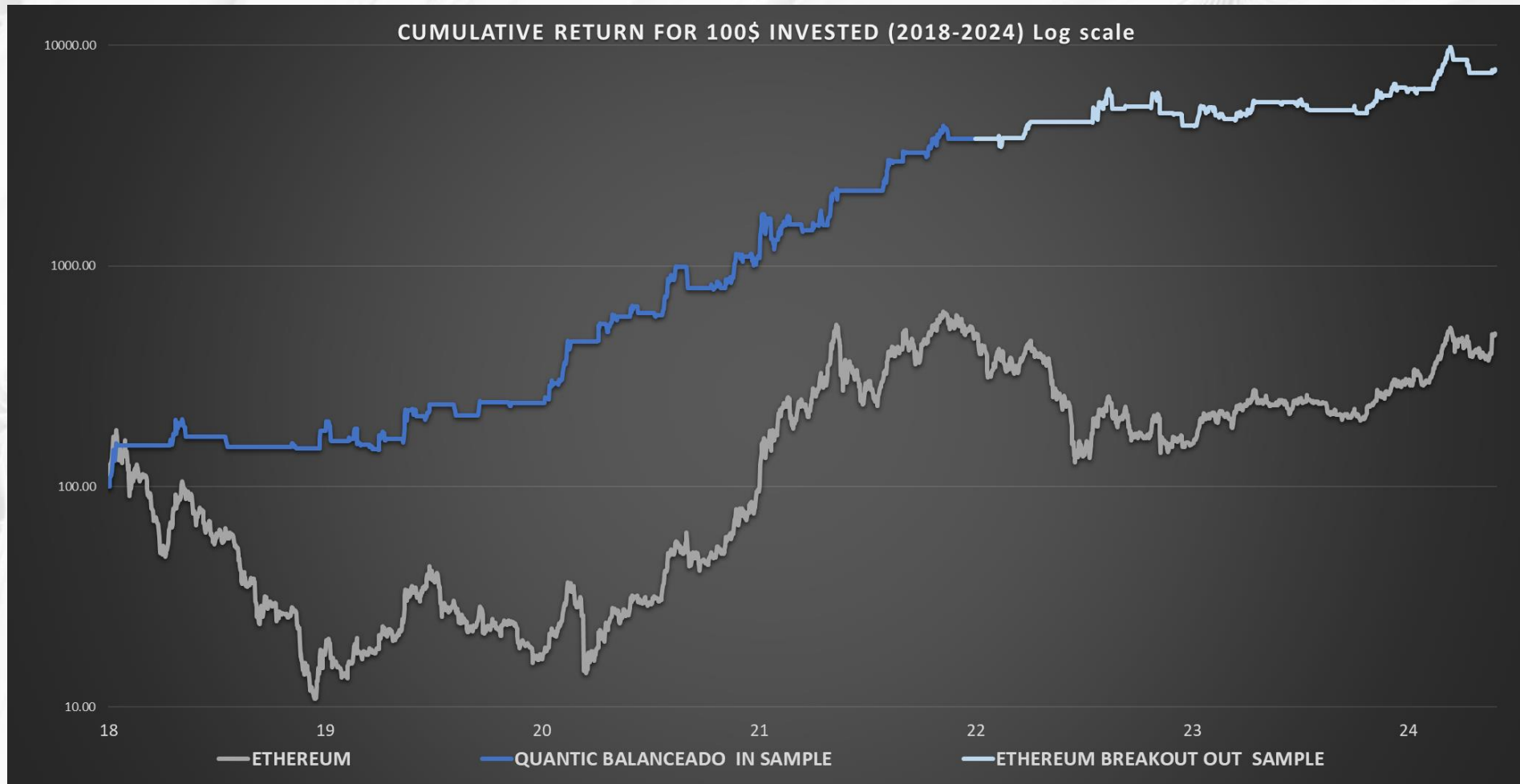
Data: El análisis se realizó utilizando datos diarios OHLCV (O: Apertura, H: Máximo, C: Cierre, V: Volumen). Los datos históricos (Enero de 2018 - 29 Mayo de 2024) en intervalos diarios fueron descargados de Yahoo Finance

Los resultados de este backtest se basan en datos históricos y pueden no reflejar condiciones futuras del mercado. Se recomienda realizar una evaluación independiente antes de tomar decisiones de inversión.

La información proporcionada en este backtest no constituye asesoramiento financiero ni recomendaciones de inversión.



METRICAS ESTRATEGIA ETHEREUM



Métricas: Las métricas presentadas se calculan utilizando datos diarios como referencia

Comisiones: Todos los resultados, métricas y backtest incluyen las comisiones de 0.25% por operación.

Data: El análisis se realizó utilizando datos diarios OHLCV (O: Apertura, H: Máximo, C: Cierre, V: Volumen). Los datos históricos (Enero de 2018 - 29 Mayo de 2024) en intervalos diarios fueron descargados de Yahoo Finance

Los resultados de este backtest se basan en datos históricos y pueden no reflejar condiciones futuras del mercado. Se recomienda realizar una evaluación independiente antes de tomar decisiones de inversión.

La información proporcionada en este backtest no constituye asesoramiento financiero ni recomendaciones de inversión.





— QUANTITATIVE INVESTMENT SOLUTIONS —

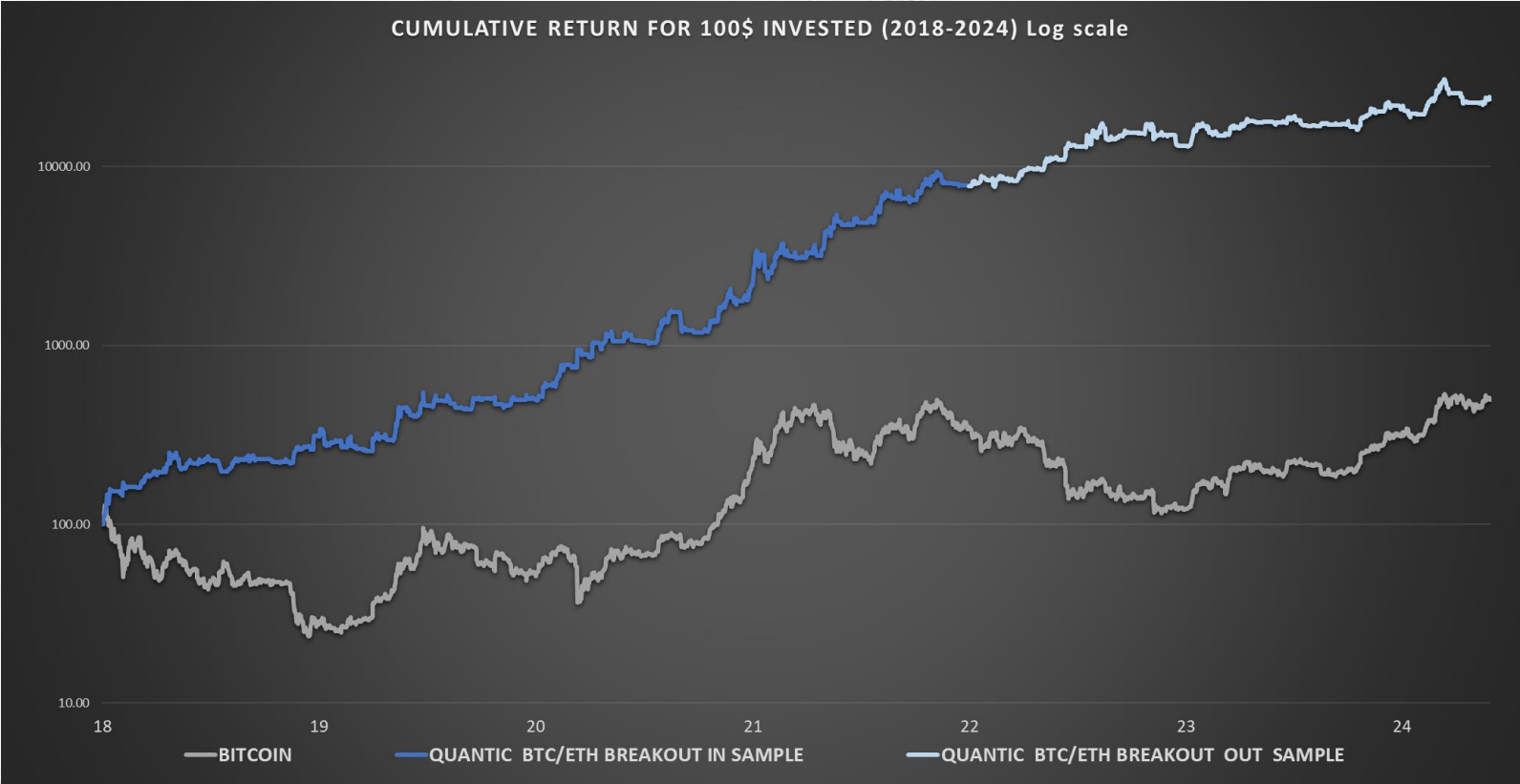
PORTFOLIO REPORT



QUANTIC BTC ETH BREAKOUT (LONG-SHORT)

METRICAS BTC-ETH BREAKOUT

2018-2024	METRICS	
METRIC	BITCOIN	QUANTIC BTC-ETH BREAKOUT L/S
Ann. Return	28.3%	134.7%
Ann Volatily	69.5%	51.6%
Max Drawdown	-81.5%	-30.9%
Sharpe Ratio (R/V)	0.4	2.6
Calmar Ratio (R/ MD)	0.35	4.4
Correlation	100%	17%
Positive Months	50%	69%
Min Month	-38%	-22%
Average Month	4.2%	8.3%
TIME IN MARKET	100%	60.0%



Métricas: Las métricas presentadas se calculan utilizando datos diarios como referencia

Comisiones: Todos los resultados, métricas y backtest incluyen las comisiones de 0.25% por operación.

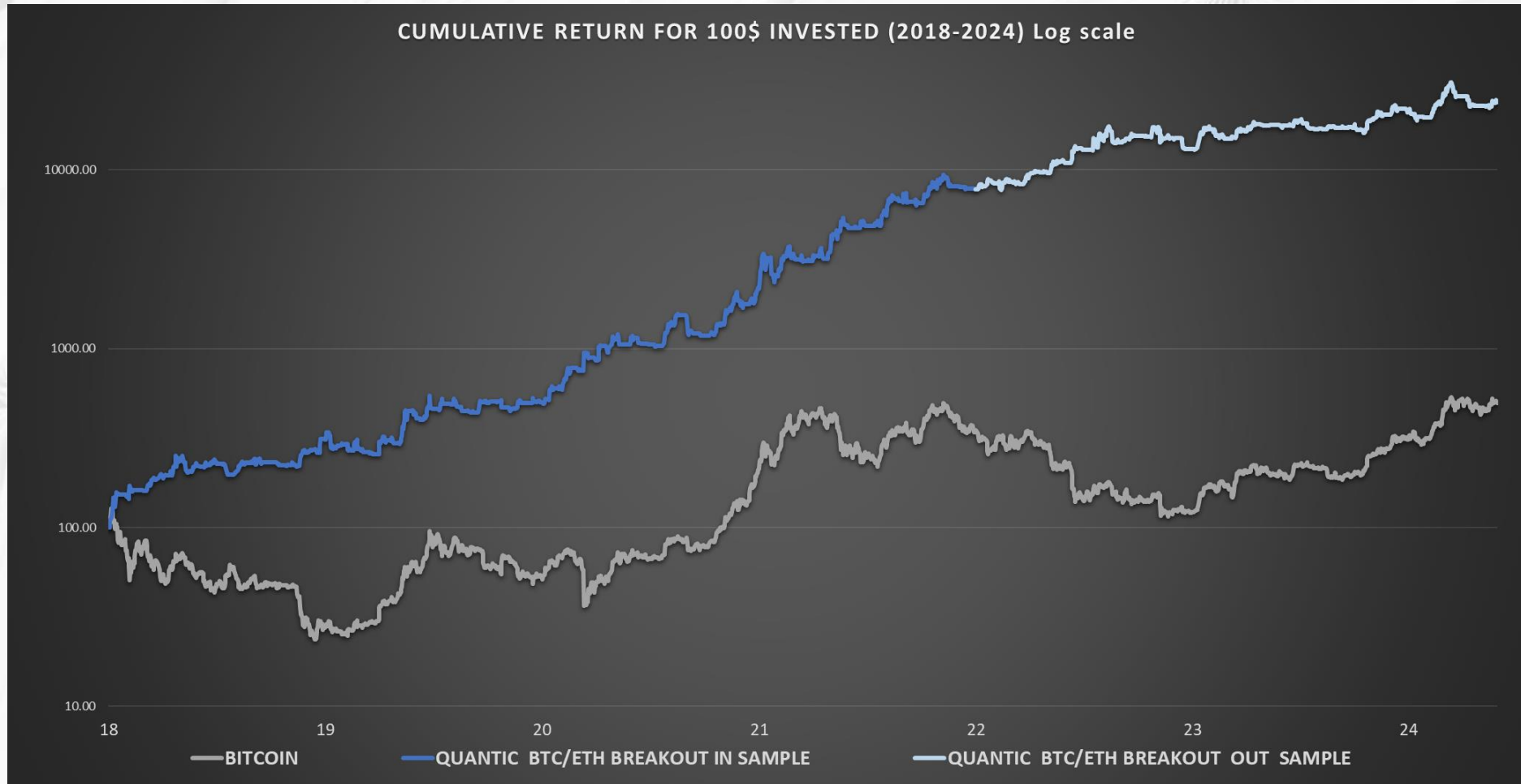
Data: El análisis se realizó utilizando datos diarios OHLCV (O: Apertura, H: Máximo, C: Cierre, V: Volumen). Los datos históricos (Enero de 2018 - 29 Mayo de 2024) en intervalos diarios fueron descargados de Yahoo Finance

Los resultados de este backtest se basan en datos históricos y pueden no reflejar condiciones futuras del mercado. Se recomienda realizar una evaluación independiente antes de tomar decisiones de inversión.

La información proporcionada en este backtest no constituye asesoramiento financiero ni recomendaciones de inversión.



METRICAS BTC-ETH BREAKOUT



Métricas: Las métricas presentadas se calculan utilizando datos diarios como referencia

Comisiones: Todos los resultados, métricas y backtest incluyen las comisiones de 0.25% por operación.

Data: El análisis se realizó utilizando datos diarios OHLCV (O: Apertura, H: Máximo, C: Cierre, V: Volumen). Los datos históricos (Enero de 2018 - 29 Mayo de 2024) en intervalos diarios fueron descargados de Yahoo Finance

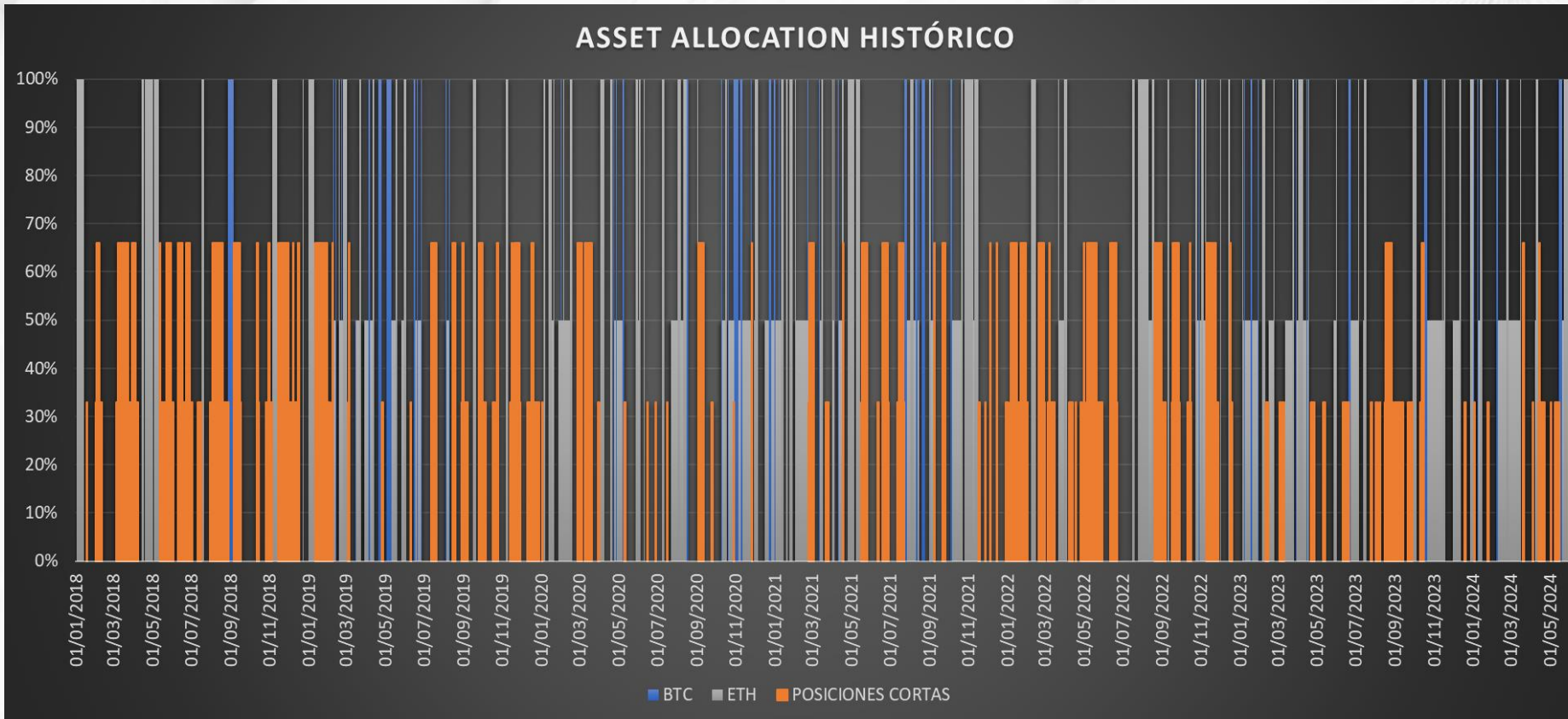
Los resultados de este backtest se basan en datos históricos y pueden no reflejar condiciones futuras del mercado. Se recomienda realizar una evaluación independiente antes de tomar decisiones de inversión.

La información proporcionada en este backtest no constituye asesoramiento financiero ni recomendaciones de inversión.

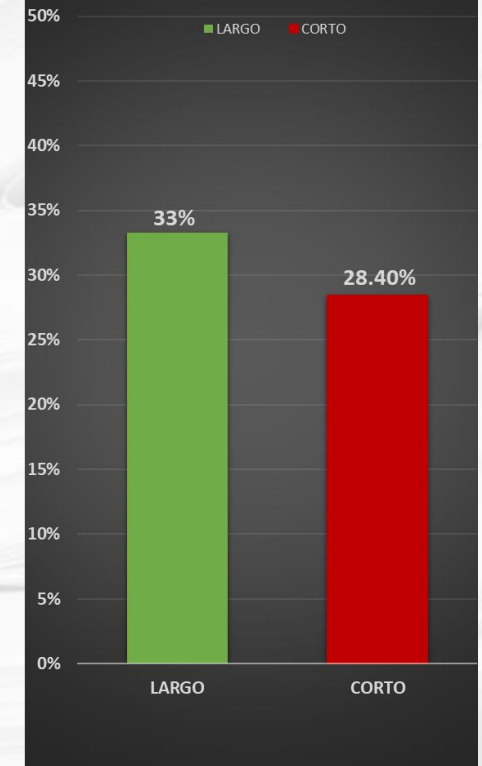




ASSET ALLOCATION HISTÓRICO



TIEMPO EN MERCADO



POSICIONES LARGAS:

Se distribuye el 100% de capital entre el numero de señales que indiquen mantener una posición abierta. Si solo la estrategia de BTC o ETH tienen señal de compra, la posición es del 100%, en caso de tener señales de compra para los 2 activos, el peso es del 50% en BTC y 50% en ETH.

POSICIONES CORTAS:

Se asigna un 33% de peso a cada estrategia de posiciones cortas (BTC y ETH) variando el capital invertido entre el 33% y 66%.

Históricamente el portafolio ha mantenido algún tipo de operación abierta en torno al 60% del tiempo, el restante mantiene el capital en liquidez.



ANALISIS RENDIMIENTOS



RENDIMIENTOS HISTORICOS



ANNUALIZED RETURNS	INCEPTION	LAST 1Y	LAST 3Y	LAST 5Y
QUANTIC BTC/ETH BREAKOUT	134.7%	35.0%	69.4%	120.7%
BITCOIN	28.3%	143.0%	25.0%	50.5%

Rendimientos anualizados recientes:
Desde 2018 (inception), ultimo año (365 días) , 3 y 5 años.

CALENDAR YEAR RETURNS			MONTHLY RETURNS											
	QUANTIC BTC/ETH BREAKOUT	BITCOIN	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec
2018	208.9%	-72.6%	47.9%	8.4%	20.8%	20.9%	-5.6%	4.1%	-13.4%	16.2%	-0.5%	-3.0%	17.8%	17.1%
2019	61.7%	92.2%	-5.6%	-5.8%	-7.0%	15.4%	46.6%	6.7%	5.7%	-8.7%	11.2%	-5.5%	5.8%	1.0%
2020	330.5%	303.2%	18.5%	30.6%	11.2%	28.6%	-0.3%	-4.4%	20.8%	18.4%	-22.1%	17.7%	31.7%	18.1%
2021	262.9%	59.7%	17.9%	32.2%	-8.1%	11.8%	37.2%	2.2%	21.1%	12.2%	-1.6%	28.8%	-3.7%	-2.7%
2022	66.4%	-64.3%	7.9%	0.8%	5.2%	8.6%	12.4%	18.5%	17.4%	-6.4%	8.2%	8.6%	-9.8%	-13.7%
2023	60.2%	155.4%	28.9%	-11.2%	11.8%	6.4%	-2.1%	8.7%	-10.3%	1.2%	0.8%	10.6%	6.1%	2.9%
2024	14.1%	59.9%	-5.8%	31.3%	0.1%	-11.8%	4.5%							

Rendimientos anuales 01/01/2018 a 29/05/2024

Métricas: Las métricas presentadas se calculan utilizando datos diarios como referencia

Comisiones: Todos los resultados, métricas y backtest incluyen las comisiones de 0.25% por operación y 10% fee mensual sobre incrementos de capital.

Data: El análisis se realizó utilizando datos diarios OHLCV (O: Apertura, H: Máximo, C: Cierre, V: Volumen). Los datos históricos (enero de 2018 - 29 Mayo de 2024) en intervalos diarios fueron descargados de Yahoo Finance

Los resultados de este backtest se basan en datos históricos y pueden no reflejar condiciones futuras del mercado. Se recomienda realizar una evaluación independiente antes de tomar decisiones de inversión.

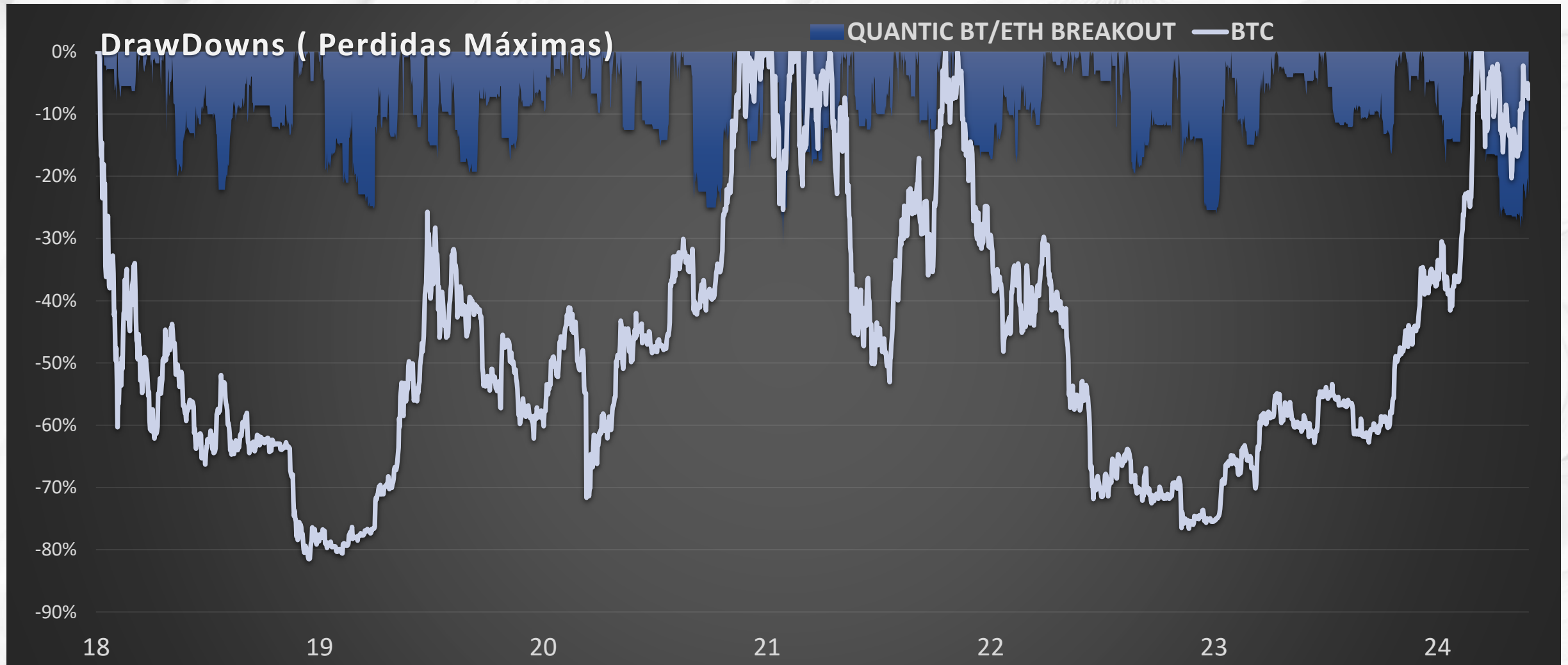
La información proporcionada en este backtest no constituye asesoramiento financiero ni recomendaciones de inversión.



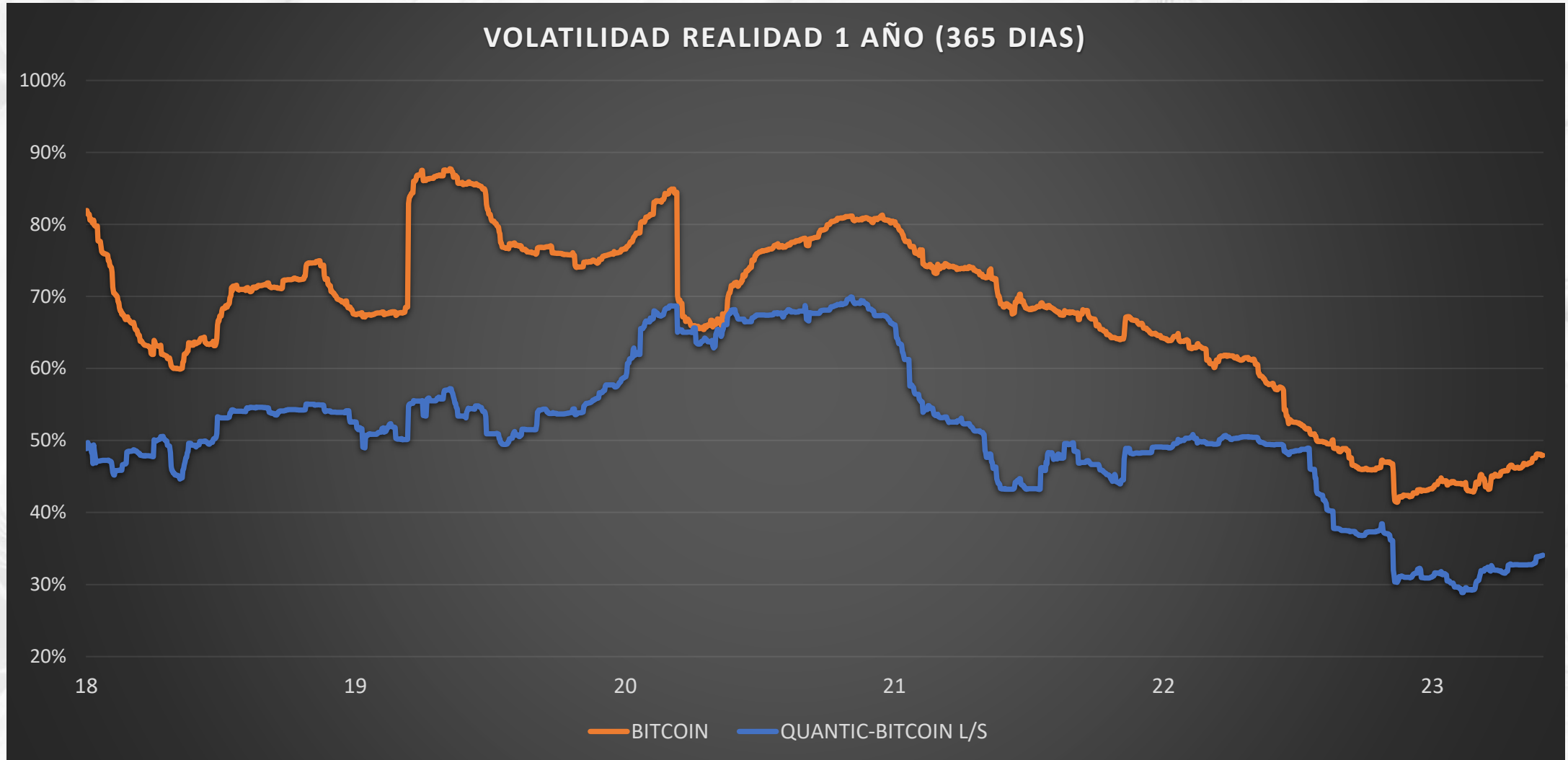
ANALISIS RIESGOS



PERDIDAS MAXIMAS



VOLATILIDAD REALIZADA



MINIMO RENDIMIENTO ACUMULADO ANUALIZADO

