

The background features a low-angle, upward-looking view of several modern skyscrapers with glass facades. The image is overlaid with several large, semi-transparent geometric shapes in various shades of blue and purple, creating a layered, architectural effect. The Quantic logo, a stylized white 'Q' with a circular cutout, is positioned to the left of the main text.

# Quantic

— QUANTITATIVE INVESTMENT SOLUTIONS —

BITCOIN/ETHEREUM | PORTAFOLIO DINÁMICO | LOW RISK

---



## ENFOQUE QUANTIC - CRYPTO

Empleamos todas las estrategias diseñadas para Bitcoin y Ethereum y las combinamos en un portafolio adaptativo

No se emplea ningún apalancamiento y se incorporan mecanismos de protección contra crisis y tendencias bajistas

Logramos un desempeño estable en todos los entornos del mercado

# FILOSOFIA DE INVERSION

Crecimiento constante y volatilidad limitada.



## CIENCIA

Sofisticadas estrategias de inversión cuantitativas y respaldadas por evidencia científica que son implementadas en un rango amplio de mercados y activos.

## ADAPTABILIDAD

Mediante modelos financieros se crea un portafolio dinámico que constantemente se adapta a las condiciones del mercado beneficiándose tanto de periodos calmos y de crisis



## RENDIMIENTOS

Rendimientos esperados elevados y superiores en entornos económicos en los que las inversiones tradicionales compuestas por acciones y bonos ofrecen oportunidades limitadas.

```
dateList = []
timeSteps = len(dateList) # It can be
barIterator = 0

while barIterator < timeSteps:
    for symbol in backtestSymbl:
        # Historical data
        # Simple moving a
        price = data[sy
        SMA20 = data[
        SMA50 = dat
```

# TRADING CUANTITATIVO



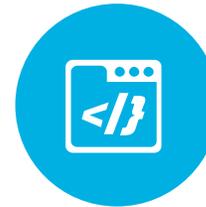
## QUE ES?

Se automatizan decisiones de compra y venta mediante la construcción de fórmulas matemáticas para modelar el movimiento del mercado. Utilizamos métodos estadísticos y numéricos para determinar cuándo comprar y cuándo vender



## ESTRATEGIAS DE INVERSION

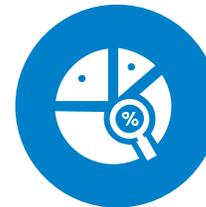
Una estrategia es un conjunto de reglas aplicadas a un determinado activo que nos señala cuando realizar compras y ventas



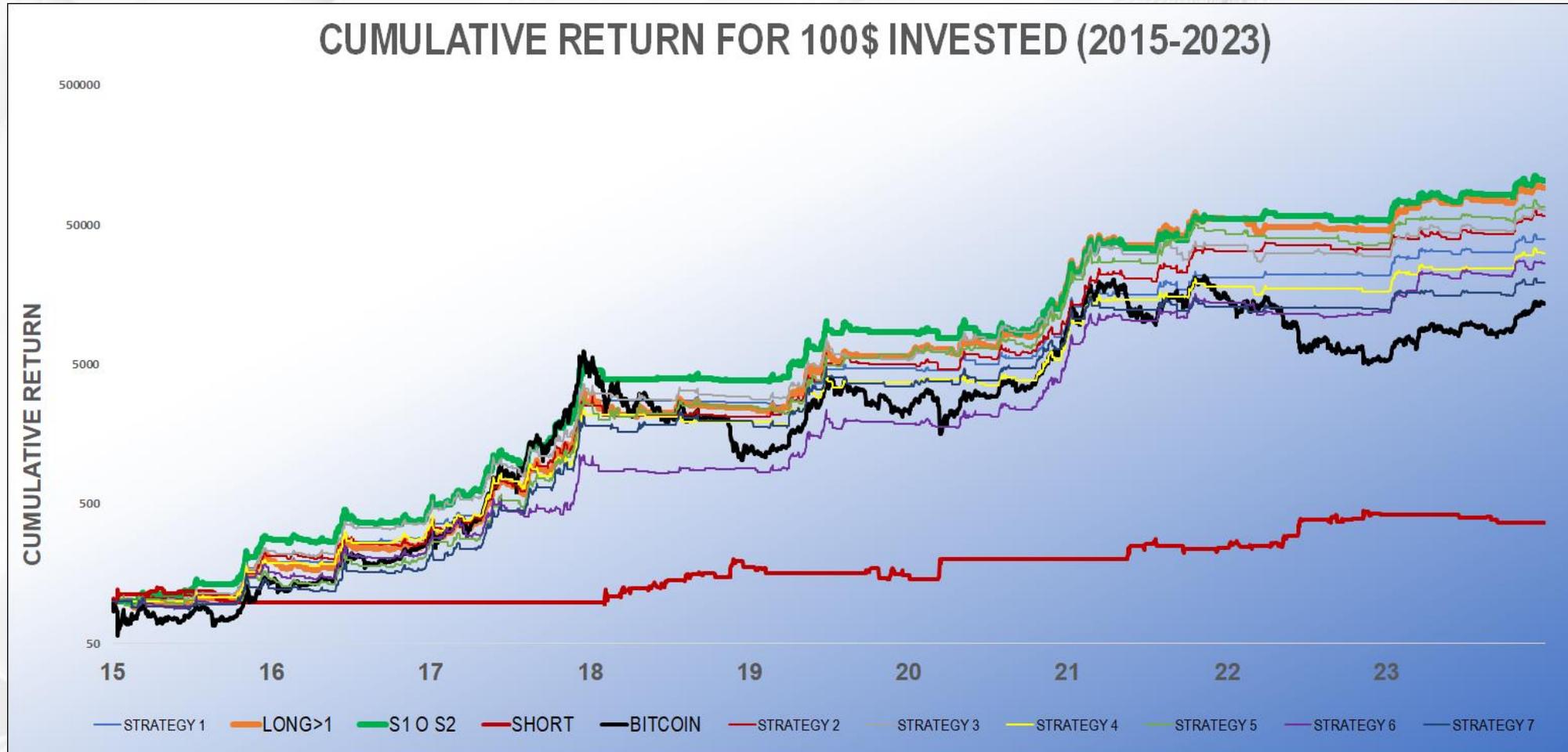
## PORTAFOLIOS DE INVERSION

- Un portafolio se refiere al conjunto completo de estrategias en las cuales planeamos invertir. Así, podemos definir de antemano la asignación porcentual que destinaremos a cada una de ellas.

- Cuando disponemos de un conjunto de estrategias, utilizamos modelos de gestión y optimización de carteras para determinar los pesos adecuados (es decir, los porcentajes de inversión asignados a cada estrategia) según el perfil de riesgo específico de cada inversor



# BTC STRATEGIES PERFORMANCE (2018-2023)



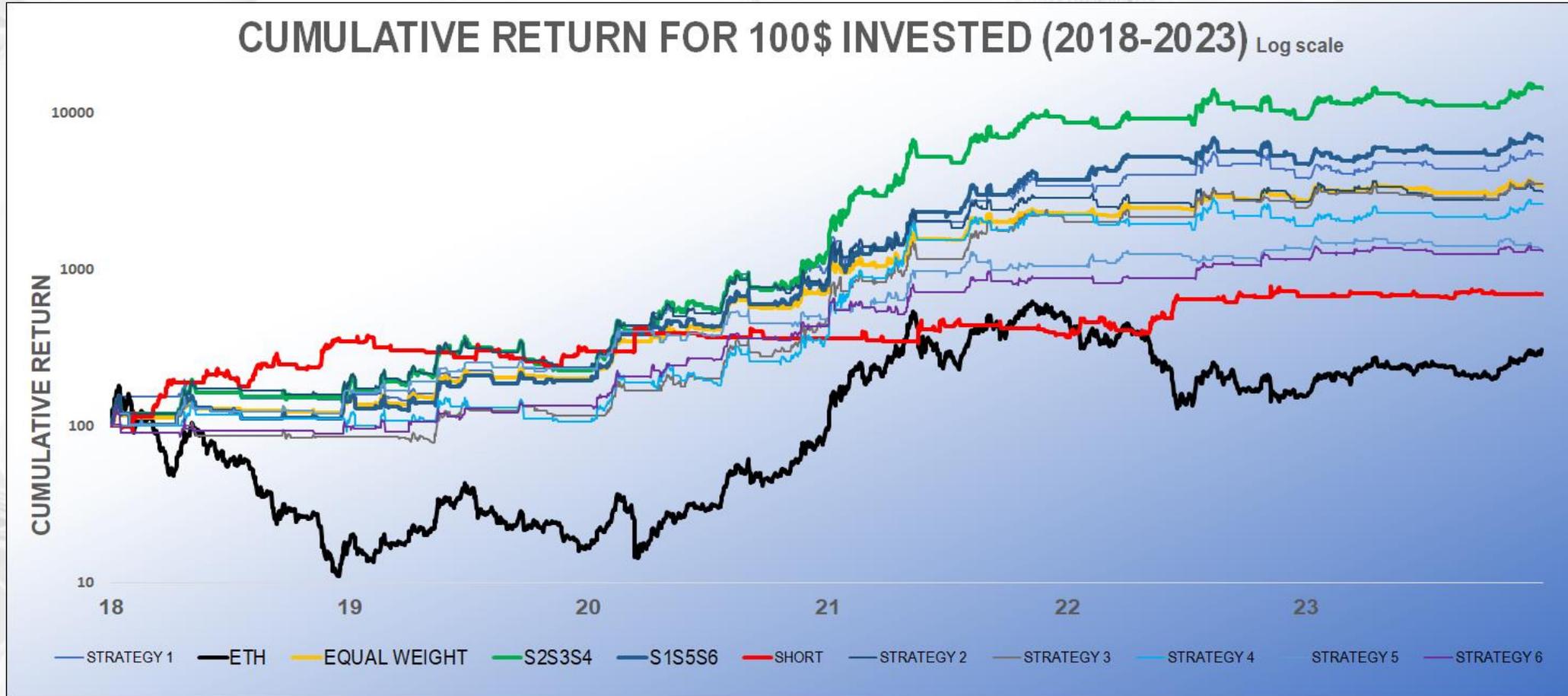
BACKTEST PERIOD : 01/01/15 to 29/12/2023

Commissions: 0,25% per trade Data: Daily data OHLCV BTC/USD Yahoo.finance -Buy at close / sell at open

S1S2 buy signal if any of the strategies (S1 OR S2) = buy signal. LONG>1 :buy signal if 2 or more strategies are active with buy signal



# ETH STRATEGIES PERFORMANCE (2018-2023)



BACKTEST PERIOD : 01/01/18 to 29/12/2023

Commissions: 0,25% per trade Data: Daily data OHLCV ETH/USD Yahoo.finance -Buy at close / sell at open

Portfolio EqualWeight 17% weight per strategy. S2S3S4: buy signal if any of the strategies (s2 ,s3 or s4) = buy signal. S1S5S6 :buy signal if any of the strategies( s1 s5 or s6) = buy signal. Signal = 1 →100% invested ; signal =0→ 0% invested



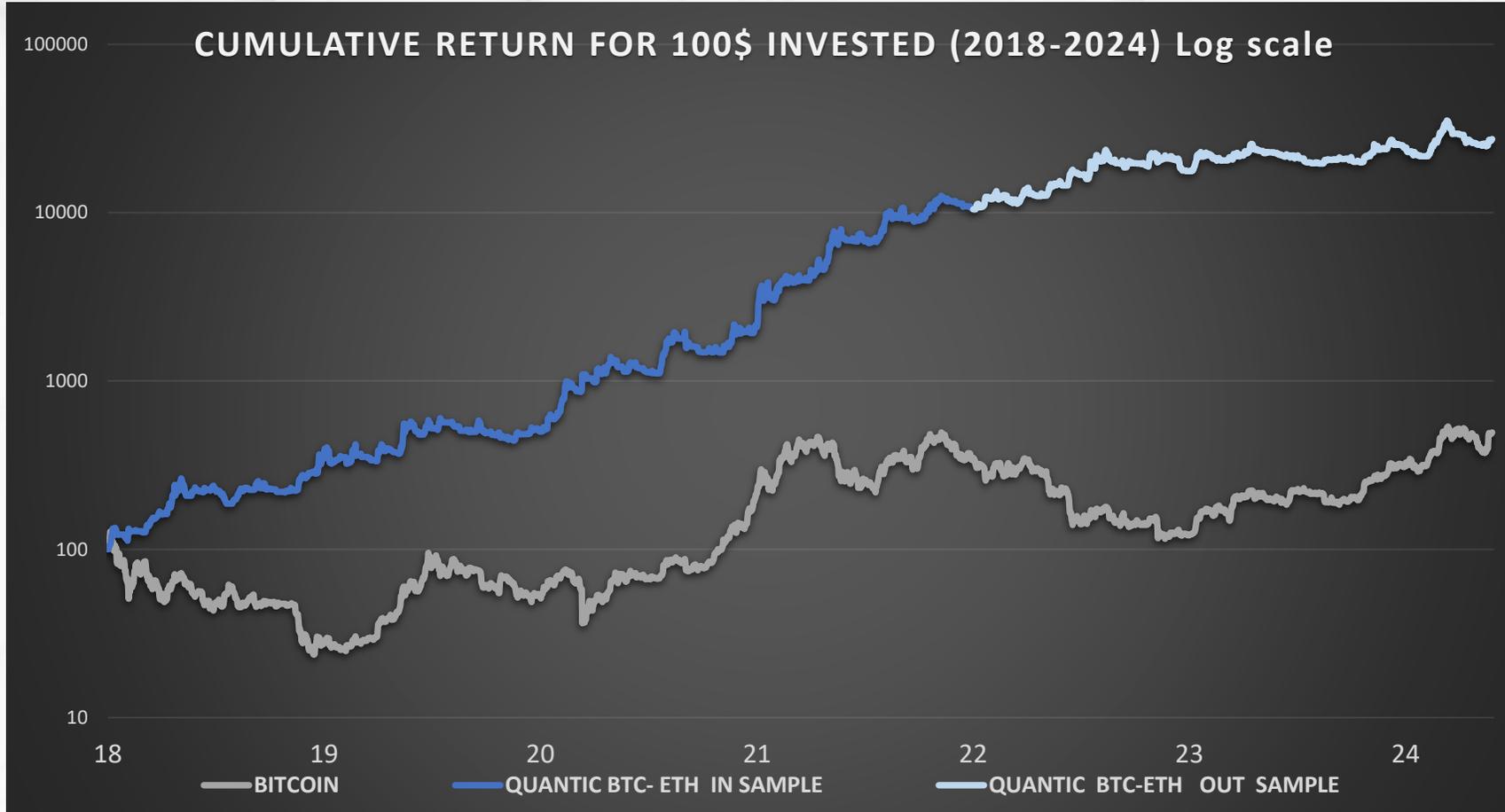


— QUANTITATIVE INVESTMENT SOLUTIONS —

# PORTFOLIO REPORT



QUANTIC BITCOIN-ETHEREUM (LONG-SHORT)



2018-2024	METRICS	
METRIC	BITCOIN	QUANTIC BTC ETH L/S
Ann. Return	28.7%	127.1%
Ann Volatily	69.9%	45.7%
Max Drawdown	-81.5%	-27.5%
Sharpe Ratio (R/V)	0.41	2.8
Calmar Ratio ( R/ MD)	0.35	4.6
Correlation	100%	16%
Positive Months	50.0%	72%
Min Month	-37.8%	-14%
Average Month	4.2%	7.7%
TIME IN MARKET	100%	78.0%

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

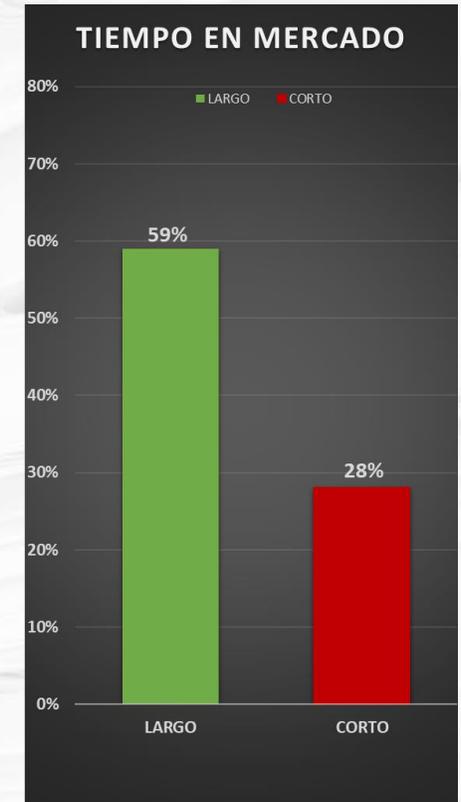
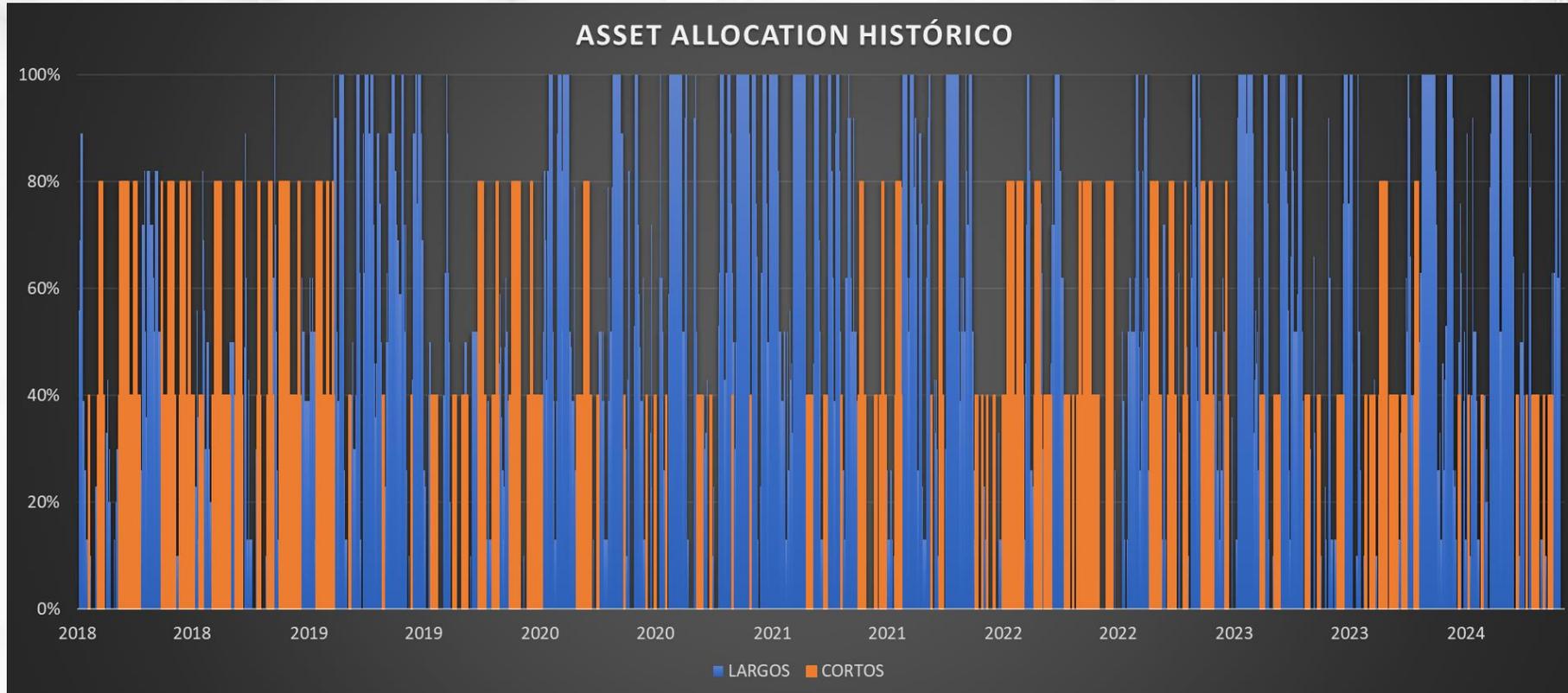
**Comisiones:** Todos los resultados, métricas y backtest incluyen las comisiones de 0.25% por operación y 10% fee mensual sobre incrementos de capital.

**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.





#### POSICIONES LARGAS:

Se distribuye el 100% de capital entre 9 grupos de estrategias, 10% cada una de BTC y 12.5% para ETH. Cada grupo de estrategias agrupa a 2 estrategias con señales de compra similares. Rupturas de canales de máximos, rupturas de volatilidad, Vix sintético o periodos de observación cortos y largos. De esta manera distribuimos el riesgo de forma similar entre estrategias las cuales esperamos que se comporten de forma similar y estén mas correlacionadas.

#### POSICIONES CORTAS:

Se asigna un 40% de peso a cada una de las estrategias de posiciones cortas ( máximo 80% si tenemos señal en BTC y ETH)



# ANALISIS RENDIMIENTOS



# RENDIMIENTOS HISTORICOS



ANNUALIZED RETURNS	INCEPTION	LAST 1Y	LAST 3Y	LAST 5Y
<b>QUANTIC BTC-ETH</b>	<b>127.1%</b>	<b>25.6%</b>	<b>58.9%</b>	<b>114.8%</b>
<b>BITCOIN</b>	<b>28.3%</b>	<b>143.0%</b>	<b>25.0%</b>	<b>50.5%</b>

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

CALENDAR YEAR RETURNS			MONTHLY RETURNS											
	QUANTIC BTC ETH L/S	BITCOIN	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec
2018	149.2%	-72.6%	3.4%	11.8%	22.4%	19.3%	2.0%	4.7%	-4.8%	13.1%	0.1%	-4.8%	21.6%	10.8%
2019	64.7%	92.2%	2.2%	-1.6%	-4.1%	17.0%	41.0%	10.3%	0.3%	-1.4%	-1.4%	-8.8%	5.8%	-0.2%
2020	304.4%	303.2%	15.2%	20.5%	18.9%	23.4%	-3.5%	-4.4%	25.6%	7.8%	-10.3%	11.1%	32.3%	20.5%
2021	293.4%	59.7%	35.7%	39.7%	5.1%	13.0%	24.6%	1.7%	13.5%	8.1%	-8.7%	28.7%	1.8%	-6.1%
2022	69.0%	-64.3%	7.9%	-0.8%	3.2%	1.9%	15.4%	21.4%	12.3%	-5.7%	3.5%	6.3%	2.2%	-10.0%
2023	57.6%	155.4%	27.9%	-0.9%	11.2%	1.9%	-5.8%	4.7%	-7.0%	0.8%	-0.3%	10.0%	3.5%	4.5%
2024	9.9%	62.8%	-10.5%	31.2%	4.3%	-13.8%	4.1%							

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.

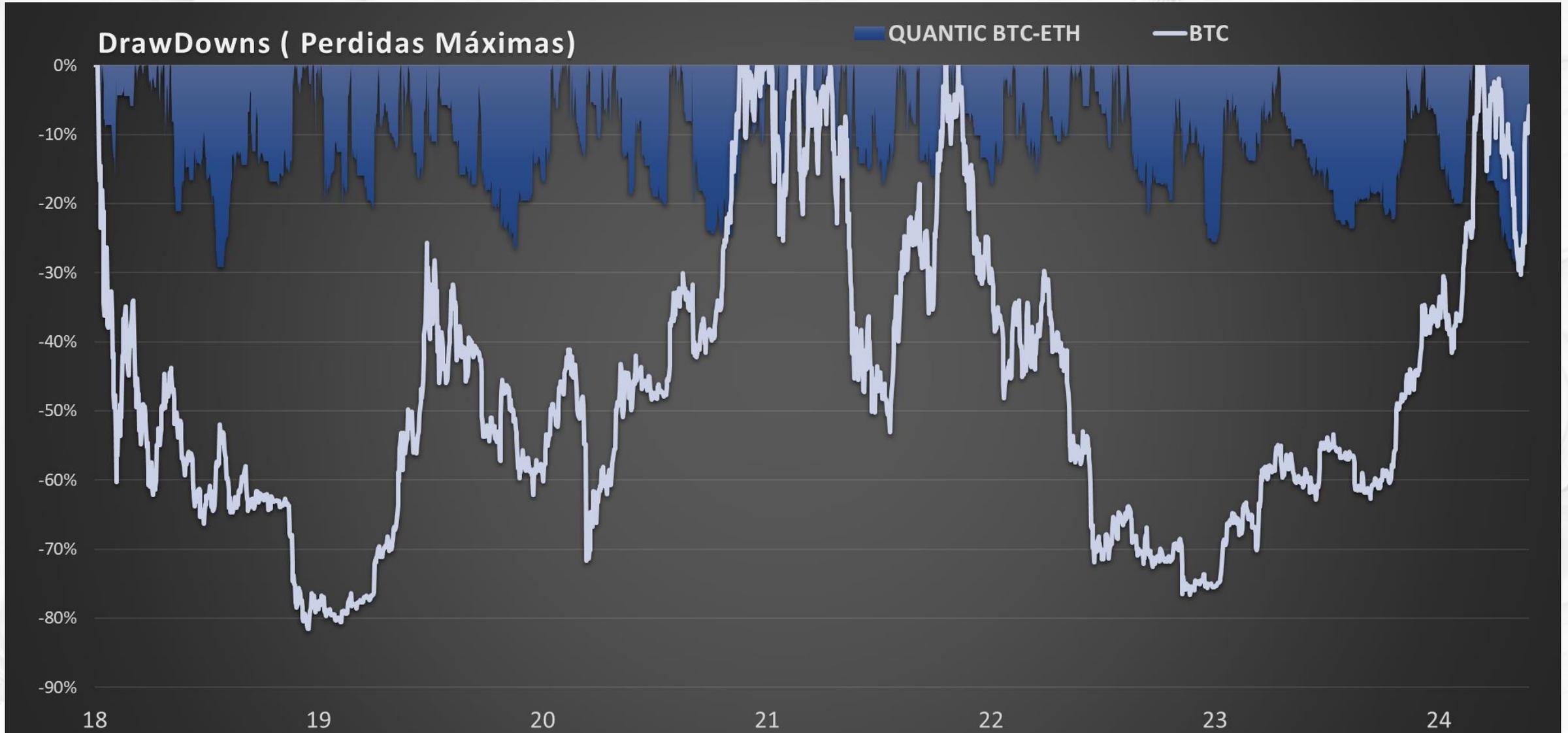
La información proporcionada en este backtest no constituye asesoramiento financiero ni recomendaciones de inversión.



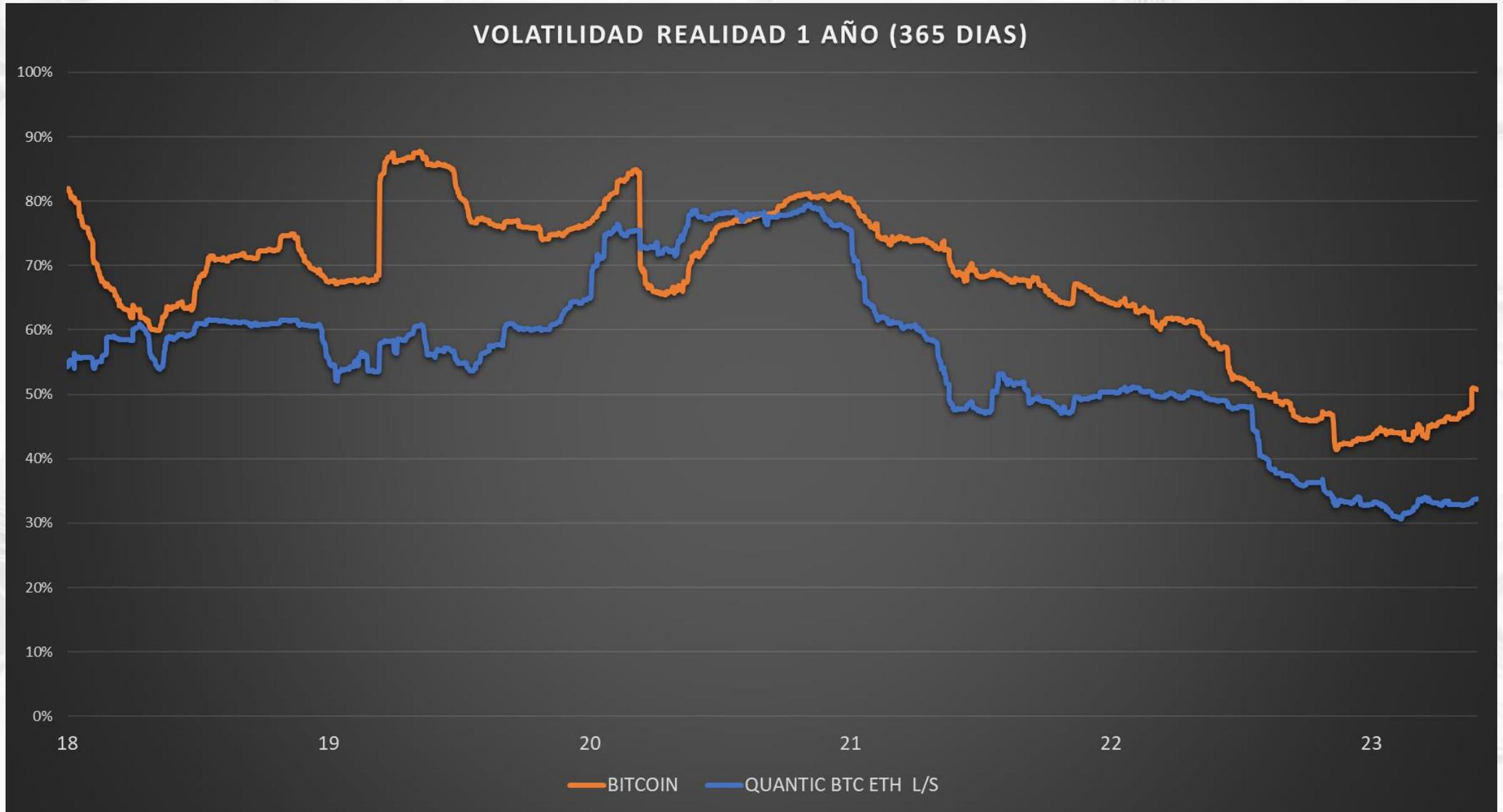
# ANALISIS RIESGOS



# PERDIDAS MAXIMAS



# VOLATILIDAD REALIZADA



# MINIMO RENDIMIENTO ACUMULADO ANUALIZADO

