



Quantic

— QUANTITATIVE INVESTMENT SOLUTIONS —

MULTIACTIVO CRYPTO | BEAR FUND



MULTIACTIVO | BEAR FUND

- Combinamos nuestras estrategias cuantitativas de forma inteligente para ofrecer portafolios de inversion dinámicos
- EL portafolio busca maximizar el rendimiento en mercados bajistas mediante la aplicacion de nuestras estrategias en el mercado de futuros, el maximo apalancamiento empleado es 1.6 el cual se alcanza unicamente en momentos puntutales.
- Se emplea un máximo del 70% del capital en posciones largas, esto como herramienta para diversificar el riesgo, suavizar rendimientos y tener una expectativa de rendimientos positivos en tendencias alcistas.

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 backtestSym
        # Historical data
        # Simple moving a
        price = data[sy
        SMA20 = data[
        SMA50 = dat
        SMA20
```

TRADING CUANTITATIVO

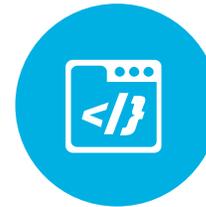


QUE ES?



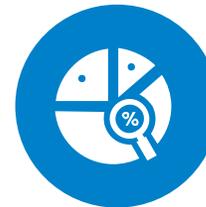
Se automatizan decisiones de compra y venta mediante la construcción de fórmulas matemáticas para modelar el movimiento del mercado. Utilizamos métodos estadísticos y numéricos para determinar cuándo comprar y cuándo vender

ESTRATEGIAS DE INVERSION



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

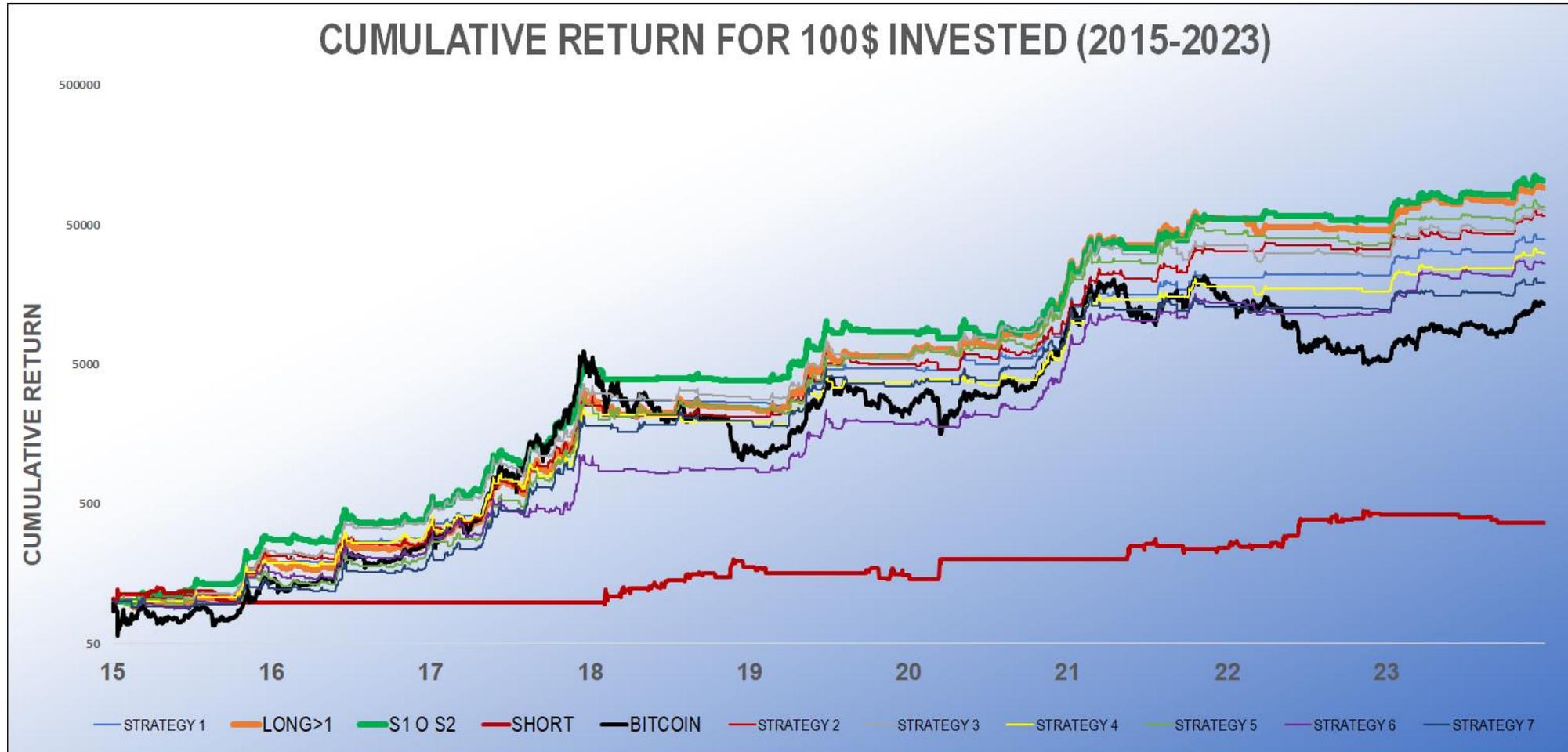
PORTAFOLIOS DE INVERSION



- 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)



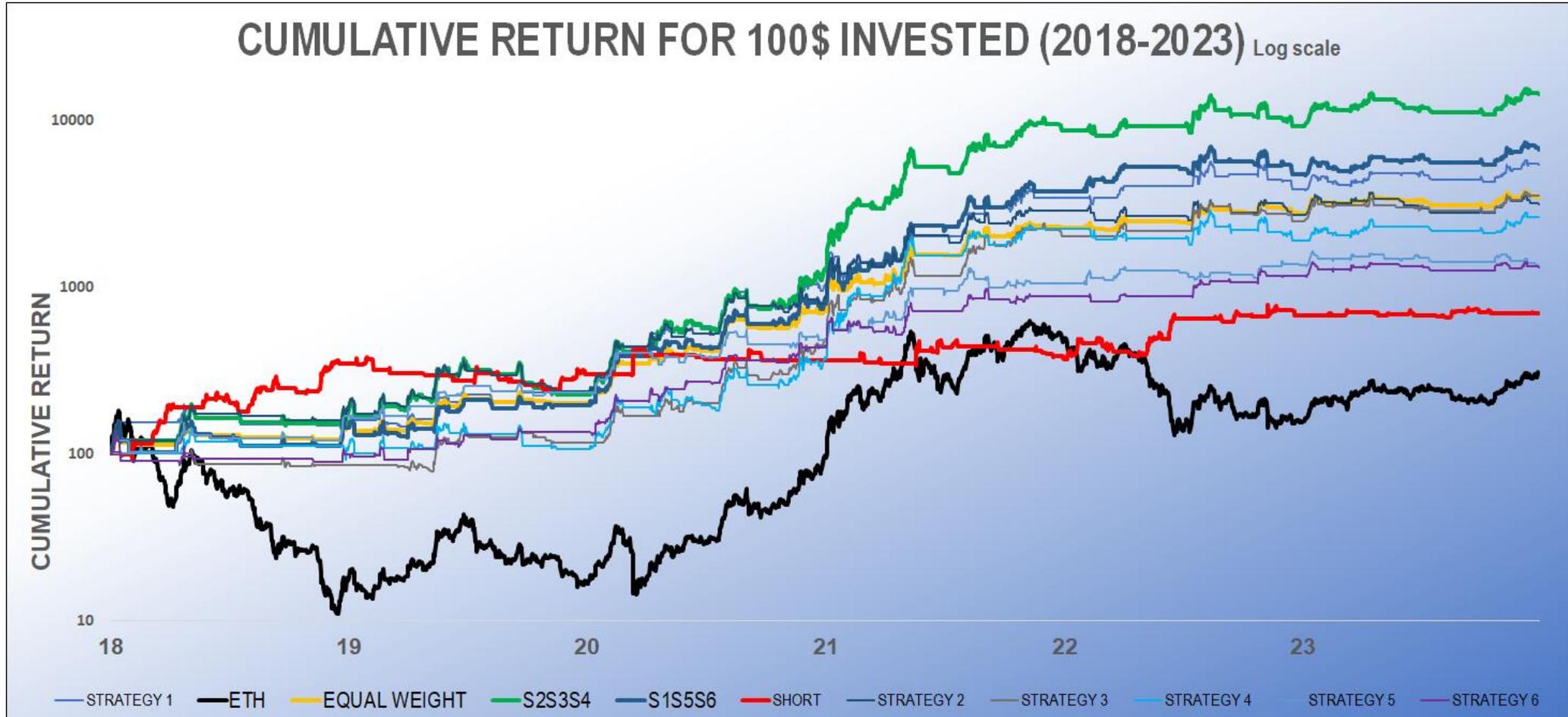
BACKTEST PERIOD : 01/01/15 to 29/12/2023

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 —

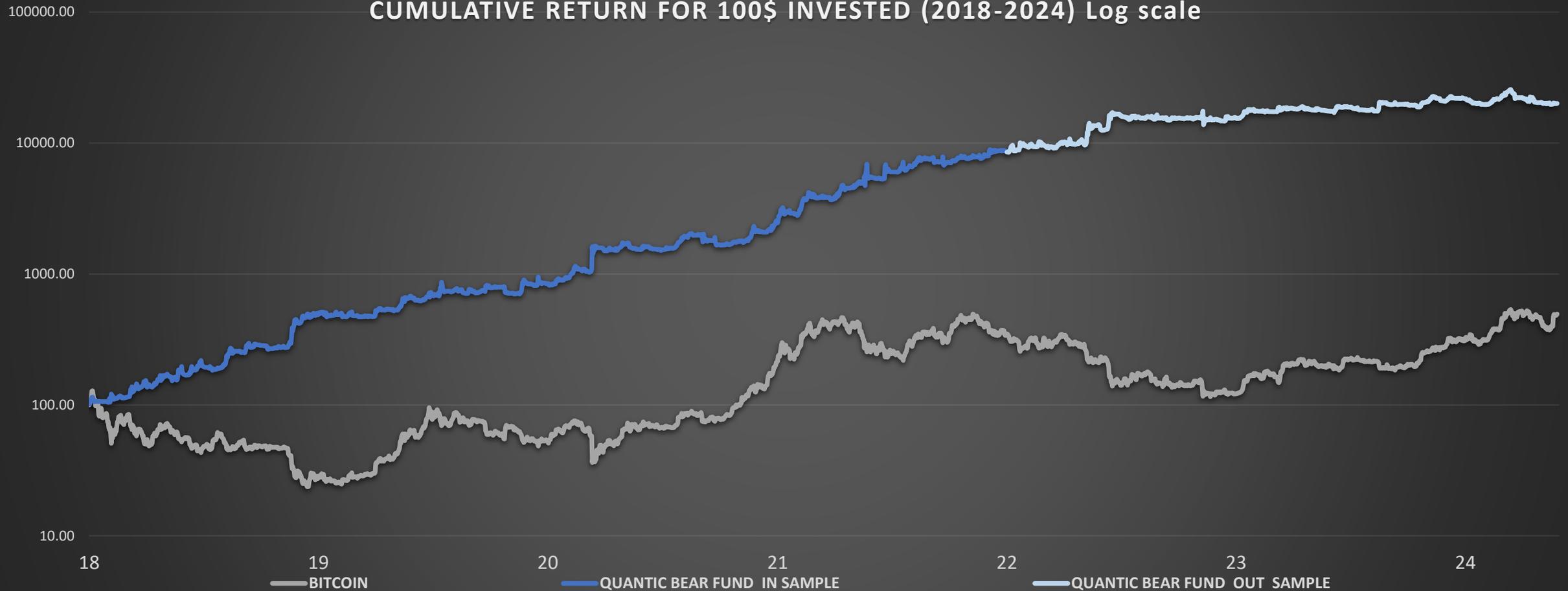
PORTFOLIO REPORT



QUANTIC BEAR FUND



CUMULATIVE RETURN FOR 100\$ INVESTED (2018-2024) Log scale



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.





 2018-2024	METRICS	
METRIC	BITCOIN	QUANTIC BEAR FUND
Ann. Return	28.7%	128.4%
Ann Volatily	69.9%	51.4%
Max Drawdown	-81.5%	-23.5%
Sharpe Ratio (R/V)	0.41	2.5
Calmar Ratio (R/ MD)	0.35	5.5
Correlation	100%	-25%
Positive Months	50.0%	75%
Min Month	-37.8%	-15%
Average Month	4.2%	7.7%
TIME IN MARKET	100%	78.0%

METRICAS SIGNIFICADO

#

Ann. Return: Rendimiento anualizado o rendimiento anual compuesto.

Ann. Volatility: Métrica de riesgo. Medida de dispersión que ofrece una visión de la posible fluctuación de precios

Max Drawdown: Máxima pérdida observada. Muestra el peor desempeño observado.

Sharpe Ratio: Rentabilidad ajustada al riesgo. Métrica de eficiencia que se obtiene al dividir el rendimiento anualizado entre la volatilidad. Mas que un valor absoluto debemos compararlo con nuestro Benchmark(ETH)

Calmar Ratio: Otra métrica de rentabilidad ajustada al riesgo y eficiencia. Rendimiento anualizado entre riesgo, esta vez el riesgo medido como la máxima pérdida. Al igual que el Sharpe Ratio debemos compararlo con nuestro Benchmark.

Correlation: Como se comporta la estrategia en relación a su benchmark, Bitcoin. La estrategia Short es la única con correlación negativa ya que se comporta de forma inversa al bitcoin. Para las que tienen correlación positiva no queremos ver valores elevados ya que implicarían que no hay una buena gestión del riesgo.

Time in market: Tiempo en el mercado: Porcentaje del tiempo que la estrategia de inversión permanece activa

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.

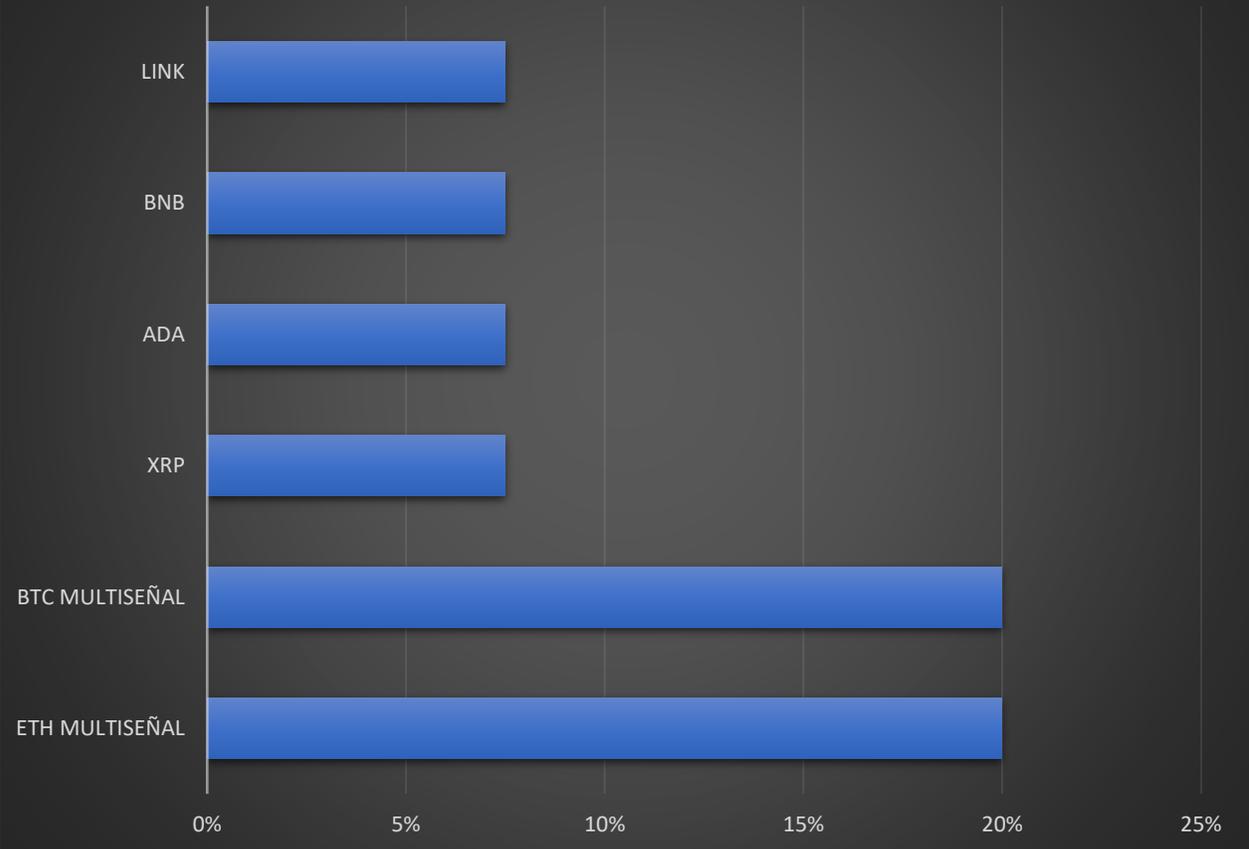
La información proporcionada en este backtest no constituye asesoramiento financiero ni recomendaciones de inversión.



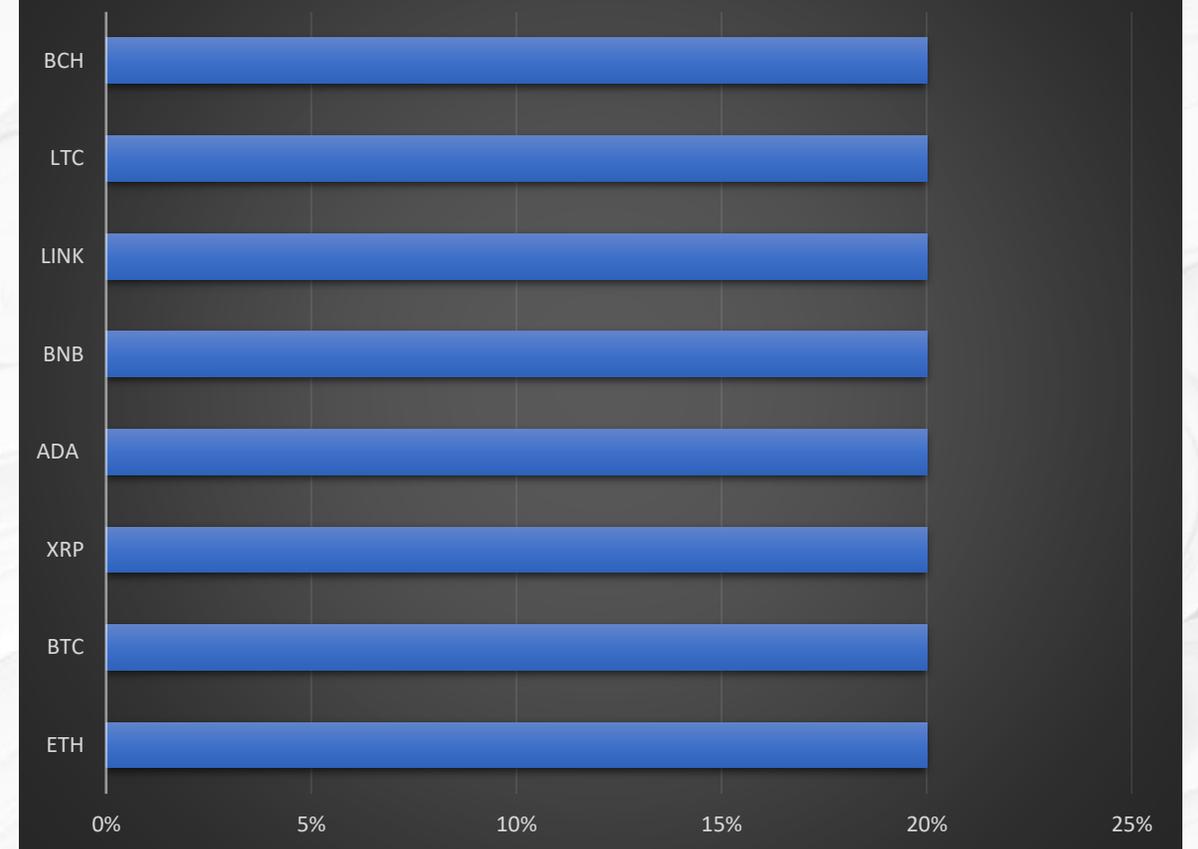
ASSET ALLOCATION



ASSET ALLOCATION / POSICIONES LARGAS

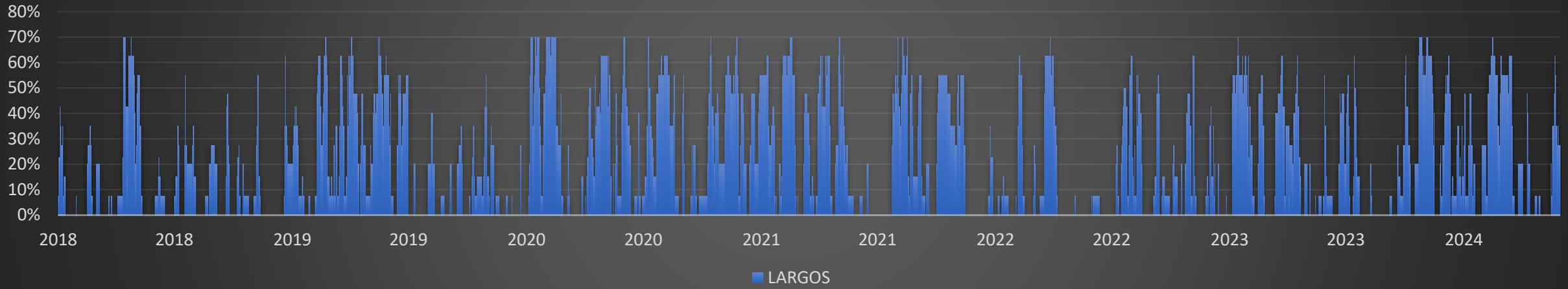


ASSET ALLOCATION / POSICIONES CORTAS

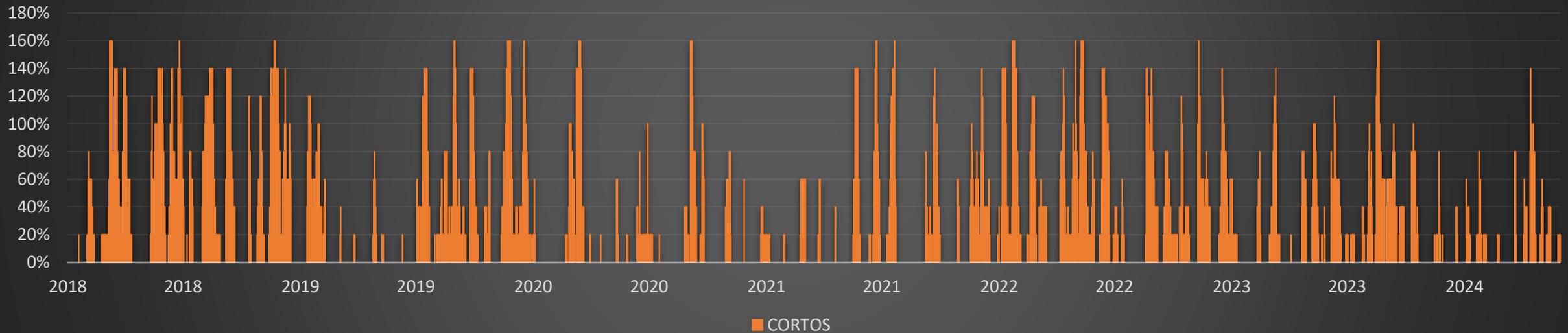




ASSET ALLOCATION HISTÓRICO



ASSET ALLOCATION HISTÓRICO



ANALISIS RENDIMIENTOS



RENDIMIENTOS HISTORICOS



ANNUALIZED RETURNS	INCEPTION	LAST 1Y	LAST 3Y	LAST 5Y
QUANTIC BEAR FUND	128.4%	15.2%	54.6%	97.4%
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 BEAR FUND	BITCOIN	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec
2018	379.8%	-72.6%	2.9%	8.8%	28.6%	12.1%	4.3%	15.7%	-2.4%	29.7%	13.3%	-2.2%	51.4%	15.9%
2019	72.8%	92.2%	1.1%	-2.8%	-1.2%	10.5%	25.0%	5.4%	5.5%	4.1%	3.6%	-9.6%	18.0%	0.6%
2020	195.0%	303.2%	9.1%	17.5%	38.7%	11.4%	-6.3%	-2.9%	18.1%	9.5%	-14.9%	6.8%	20.7%	15.5%
2021	247.0%	59.7%	14.8%	41.1%	-7.5%	22.5%	19.0%	10.7%	11.0%	12.3%	-5.5%	7.2%	4.6%	8.8%
2022	81.2%	-64.3%	9.8%	1.6%	3.0%	7.5%	17.9%	29.2%	-3.3%	-0.6%	-0.9%	1.3%	-2.8%	2.7%
2023	39.2%	155.4%	11.5%	-0.6%	6.6%	-2.5%	-3.0%	7.4%	-5.5%	11.3%	0.2%	3.7%	1.4%	4.6%
2024	-7.3%	62.8%	-9.7%	15.8%	-2.3%	-7.9%	-1.5%							

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.

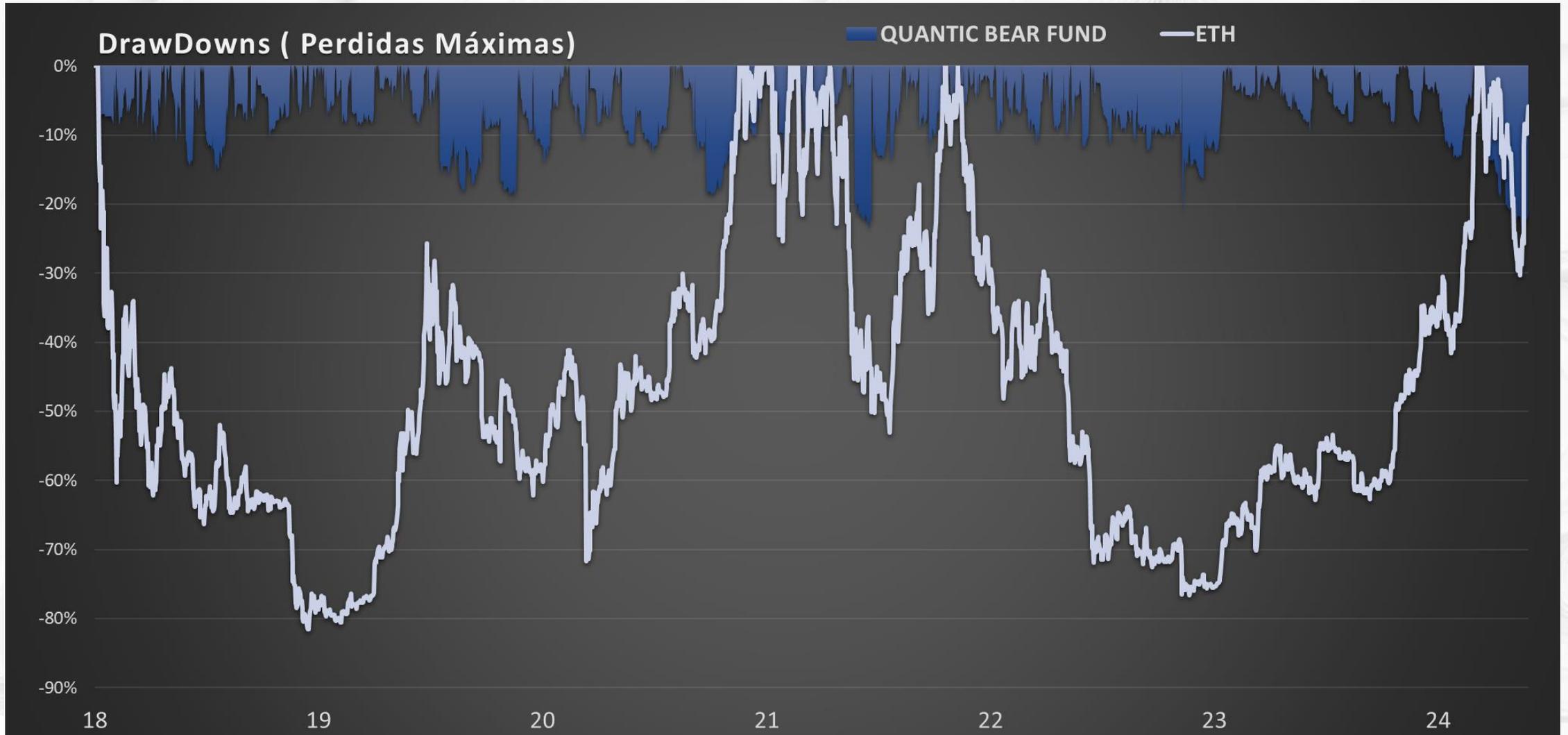
La información proporcionada en este backtest no constituye asesoramiento financiero ni recomendaciones de inversión.



ANALISIS RIESGOS



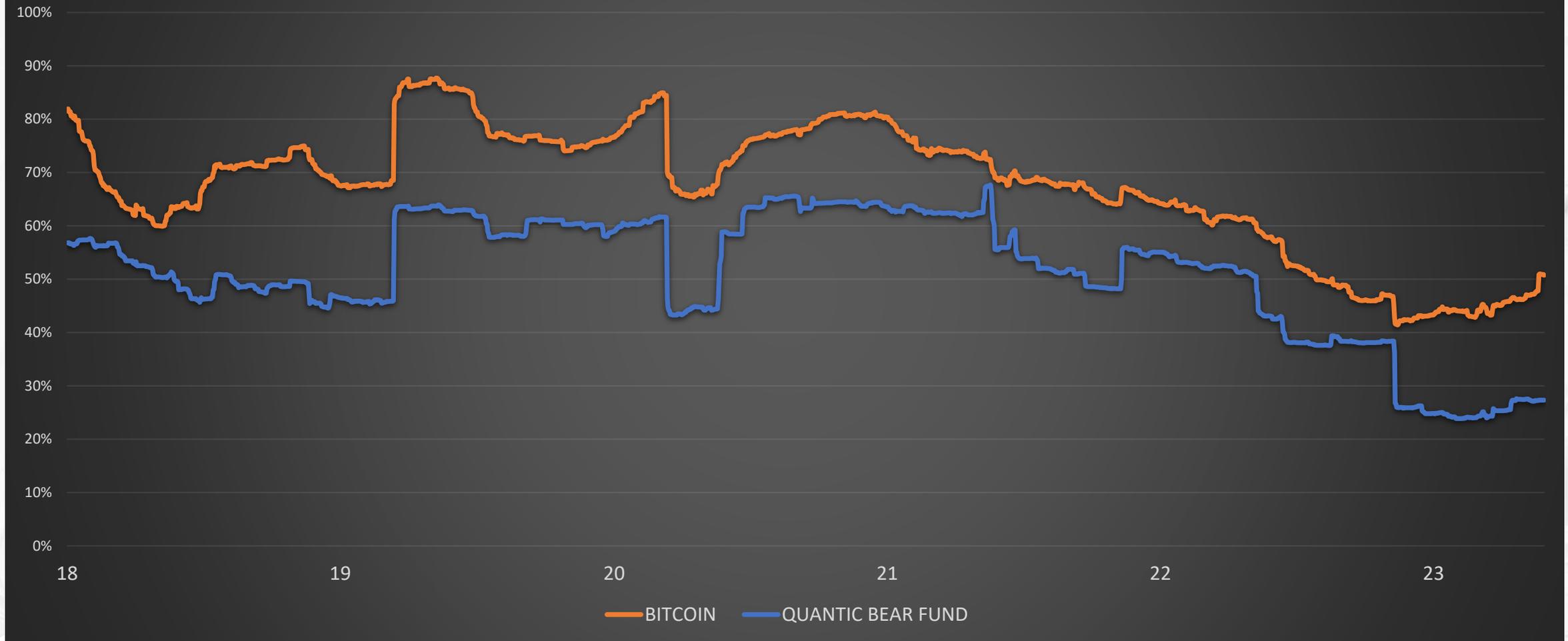
PERDIDAS MAXIMAS



VOLATILIDAD REALIZADA



VOLATILIDAD REALIDAD 1 AÑO (365 DIAS)



MINIMO RENDIMIENTO ACUMULADO ANUALIZADO

