

The logo features a stylized white 'Q' with a circular cutout on the left side, followed by the word 'Quantic' in a bold, white, sans-serif font. The background consists of overlapping geometric shapes in shades of blue and purple, with a low-angle photograph of skyscrapers visible through the layers.

Quantic

— QUANTITATIVE INVESTMENT SOLUTIONS —

BITCOIN | PORTAFOLIO DINÁMICO | LOW RISK



ENFOQUE QUANTIC - CRYPTO

Mantener Bitcoin durante sus altibajos puede ser estresante debido a su naturaleza altamente volátil y numerosas caídas históricas.

En un mercado tan dinámico, es fácil verse afectado emocionalmente por ganancias o pérdidas repentinas, lo que dificulta la toma de decisiones sobre cuándo comprar o vender.

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?



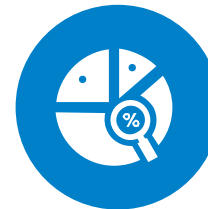
Se automatizan decisiones de compra y venta mediante la construcción de fórmulas matemáticas para modelar el movimiento del mercado. Utilizamos métodos estadísticos y numéricos para determinar cuándo comprar y cuándo vender

ESTRATEGIAS DE INVERSION



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

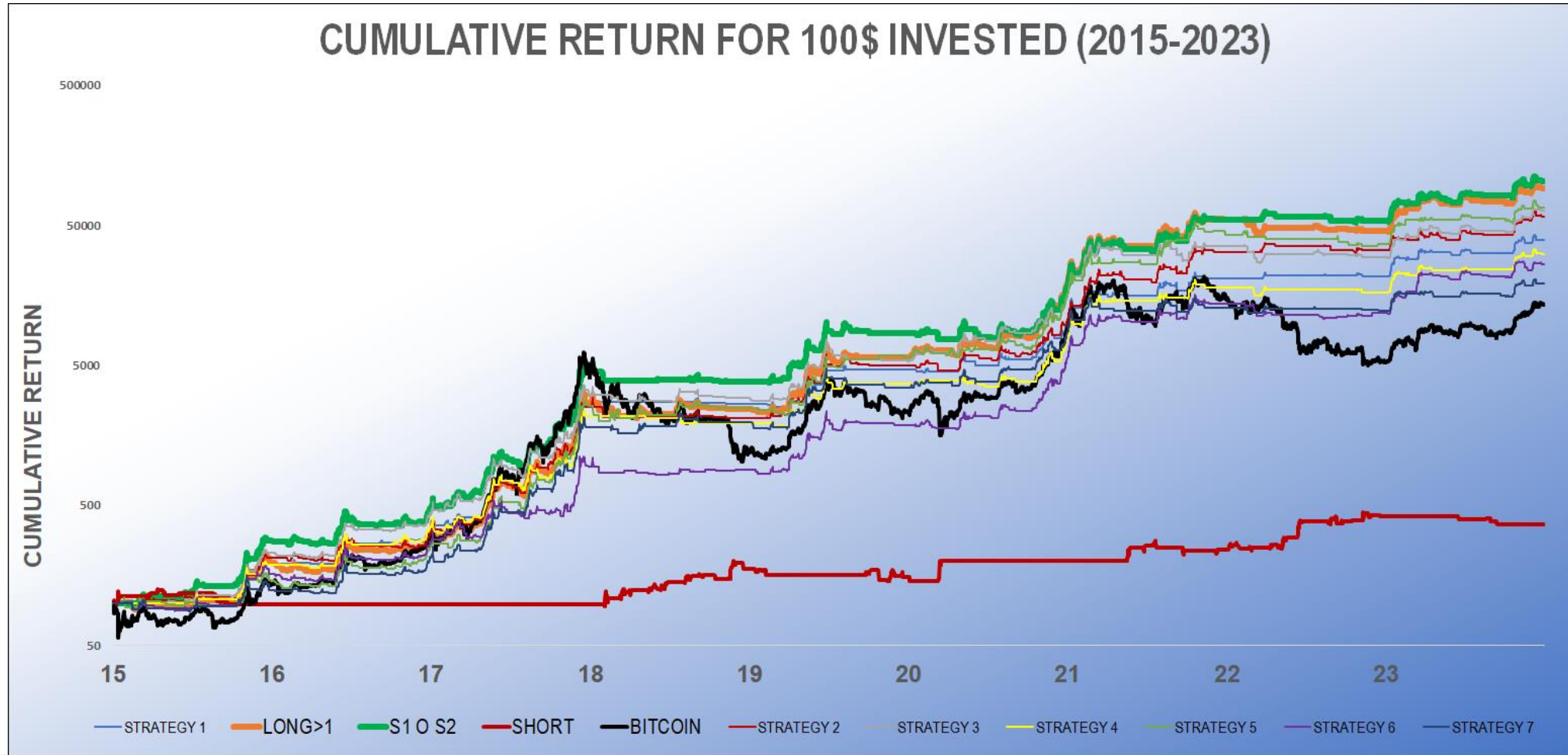
PORTAFOLIOS DE INVERSION



- 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





— QUANTITATIVE INVESTMENT SOLUTIONS —

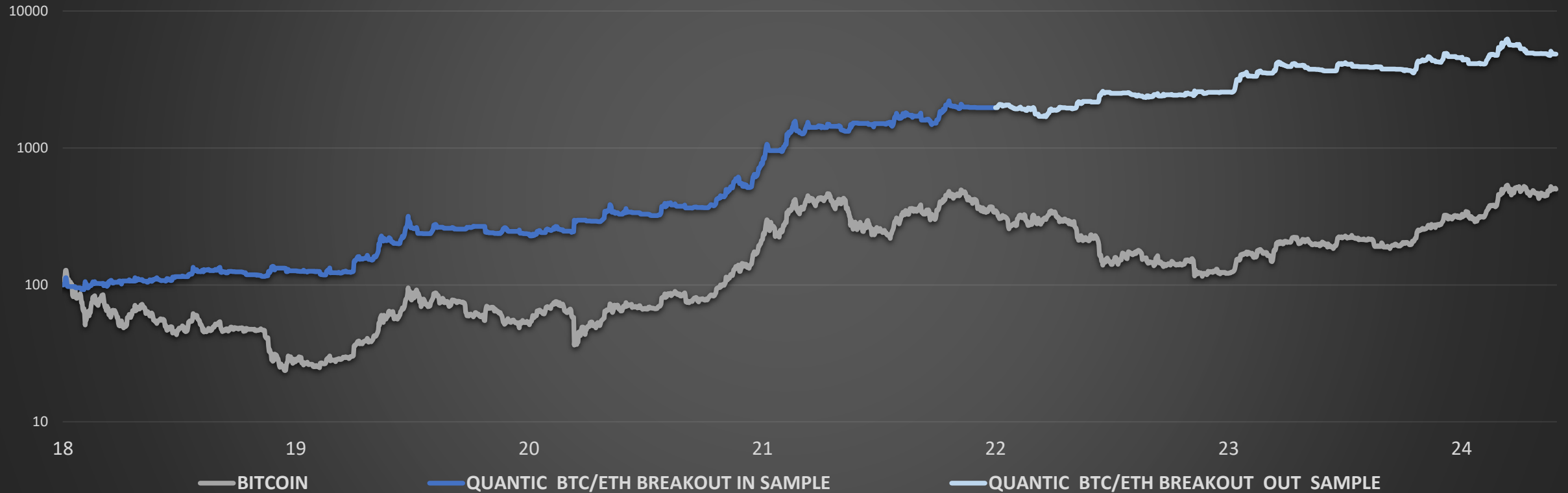
PORTFOLIO REPORT



QUANTIC BITCOIN (LONG-SHORT)



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

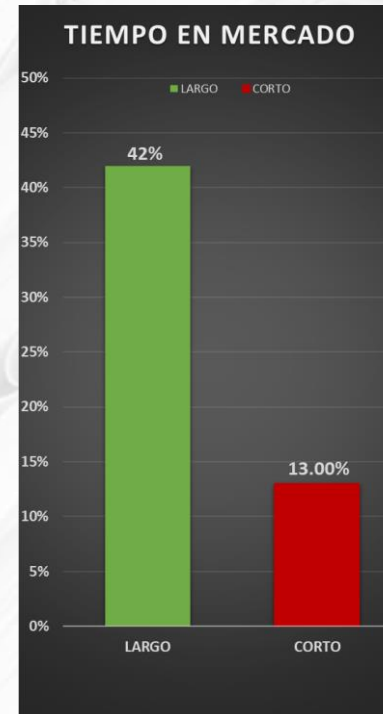
Los resultados de este backtest se basan en datos históricos y pueden no reflejar condiciones futuras del mercado. Se recomienda realizar una evaluación independiente antes de tomar decisiones de inversión.

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





| 2018-2024 | | METRICS | |
|-----------------------|---------|----------------------|--|
| METRIC | BITCOIN | QUANTIC- BITCOIN L/S | |
| Ann. Return | 28.3% | 83.3% | |
| Ann Volatily | 69.5% | 38.7% | |
| Max Drawdown | -81.5% | -28.3% | |
| Sharpe Ratio (R/V) | 0.4 | 2.2 | |
| Calmar Ratio (R/ MD) | 0.35 | 2.9 | |
| Correlation | 100% | 27% | |
| Positive Months | 50% | 63% | |
| Min Month | -38% | -14% | |
| Average Month | 4.2% | 5.8% | |
| TIME IN MARKET | 100% | 55.3% | |



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.

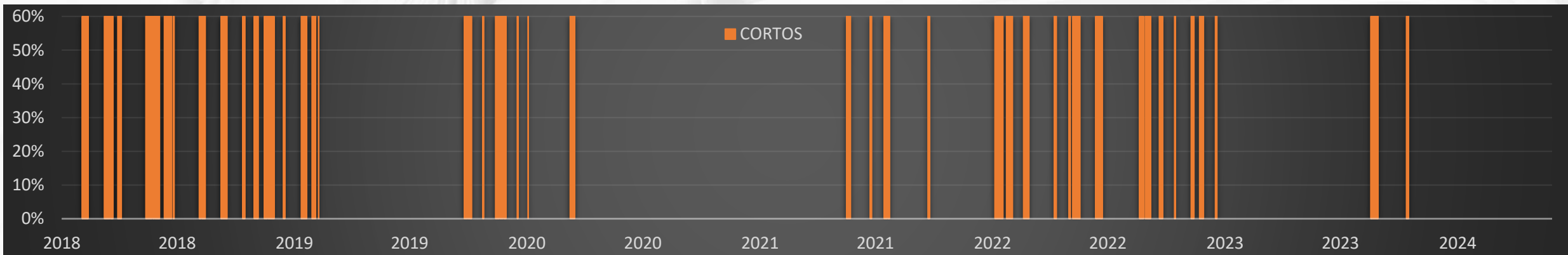
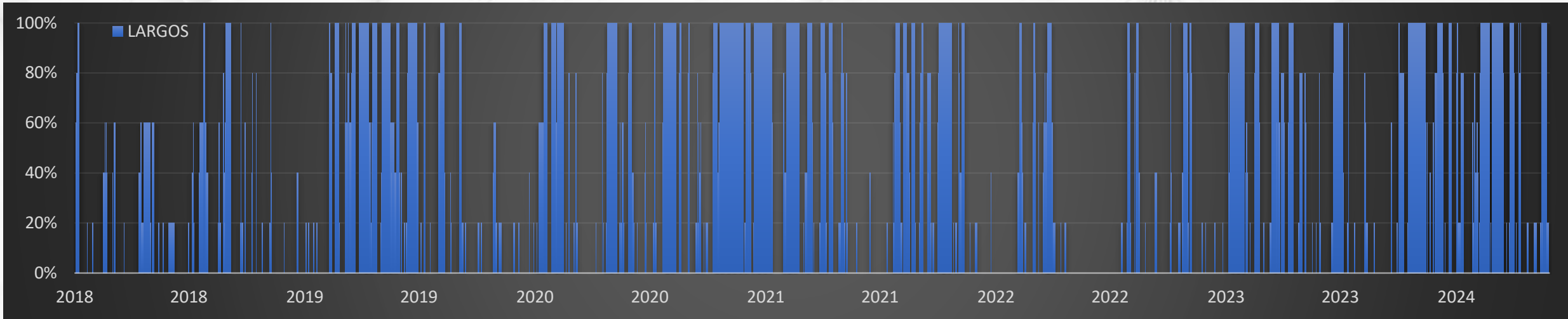
Data: El análisis se realizó utilizando datos diarios OHLCV (O: Apertura, H: Máximo, C: Cierre, V: Volumen). Los datos históricos (enero de 2018 - 29 Mayo de 2024) en intervalos diarios fueron descargados de Yahoo Finance

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



POSICIONES LARGAS:

Se distribuye el 100% de capital entre 5 grupos de estrategias, cada una 20%. Cada grupo de estrategias agrupa a 2 estrategias con señales de compra similares. Rupturas de canales de precio, 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 más correlacionadas. Estrategias dentro de cada grupo → más correlación ; correlación entre grupos → menor

POSICIONES CORTAS:

Se asigna un 60% de peso a la de posiciones cortas.

Históricamente el portafolio ha mantenido algún tipo de operación abierta en torno al 55% del tiempo, el restante mantiene el capital en liquidez.



ANALISIS RENDIMIENTOS




RENDIMIENTOS HISTORICOS



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

| ANNUALIZED RETURNS | INCEPTION | LAST 1Y | LAST 3Y | LAST 5Y |
|-------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------|
| QUANTIC BTC/ETH BREAKOUT | 83.3% | 30.5% | 47.2% | 85.2% |
| BITCOIN | 28.3% | 143.0% | 25.0% | 50.5% |

Rendimientos anuales 01/01/2018
a 29/12/2024:

| CALENDAR YEAR RETURNS | | | MONTHLY RETURNS | | | | | | | | | | | |
|--|--------------------|---------|-----------------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|
|  | QUANTIC BTC L/S | BITCOIN | Jan | Feb | Mar | Apr | May | Jun | Jul | Aug | Sep | Oct | Nov | Dec |
| 2018 | 26.8% | -72.6% | -7.5% | 10.5% | 3.5% | 3.3% | 0.1% | 5.1% | 9.0% | 2.6% | -3.2% | -4.7% | 11.8% | -4.4% |
| 2019 | 85.8% | 92.2% | -0.7% | -2.5% | 1.5% | 21.8% | 35.8% | 26.9% | -9.4% | 9.5% | 1.8% | -9.0% | 2.4% | -4.2% |
| 2020 | 221.5% | 303.2% | 7.3% | -2.2% | 18.7% | 14.3% | 0.2% | -2.2% | 15.6% | -1.7% | -1.7% | 21.4% | 23.3% | 37.7% |
| 2021 | 160.4% | 59.7% | 24.1% | 37.6% | 11.3% | 1.0% | 4.1% | -0.5% | 15.7% | -2.1% | -11.2% | 31.6% | -0.8% | -0.2% |
| 2022 | 29.6% | -64.3% | -1.7% | 0.5% | -3.8% | 4.4% | 10.8% | 15.8% | -1.0% | -4.7% | 3.4% | 1.5% | 2.6% | 0.3% |
| 2023 | 77.6% | 155.4% | 31.1% | 5.1% | 13.4% | 0.1% | -8.5% | 12.3% | -4.7% | -3.9% | -0.5% | 15.1% | -2.3% | 7.7% |
| 2024 | 6.9% | 61.6% | -9.6% | 27.5% | 9.0% | -14.3% | -0.7% | | | | | | | |

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.

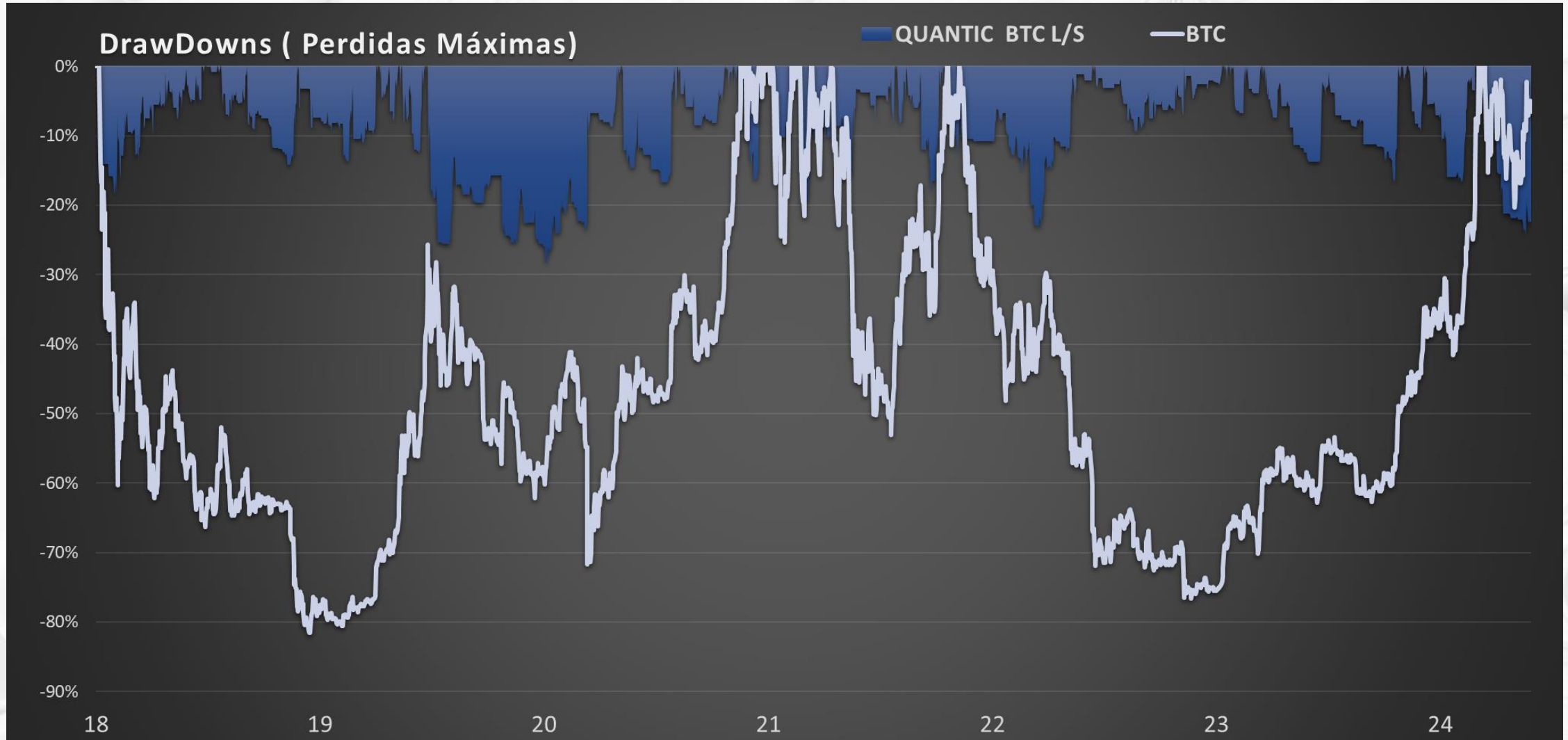
La información proporcionada en este backtest no constituye asesoramiento financiero ni recomendaciones de inversión.



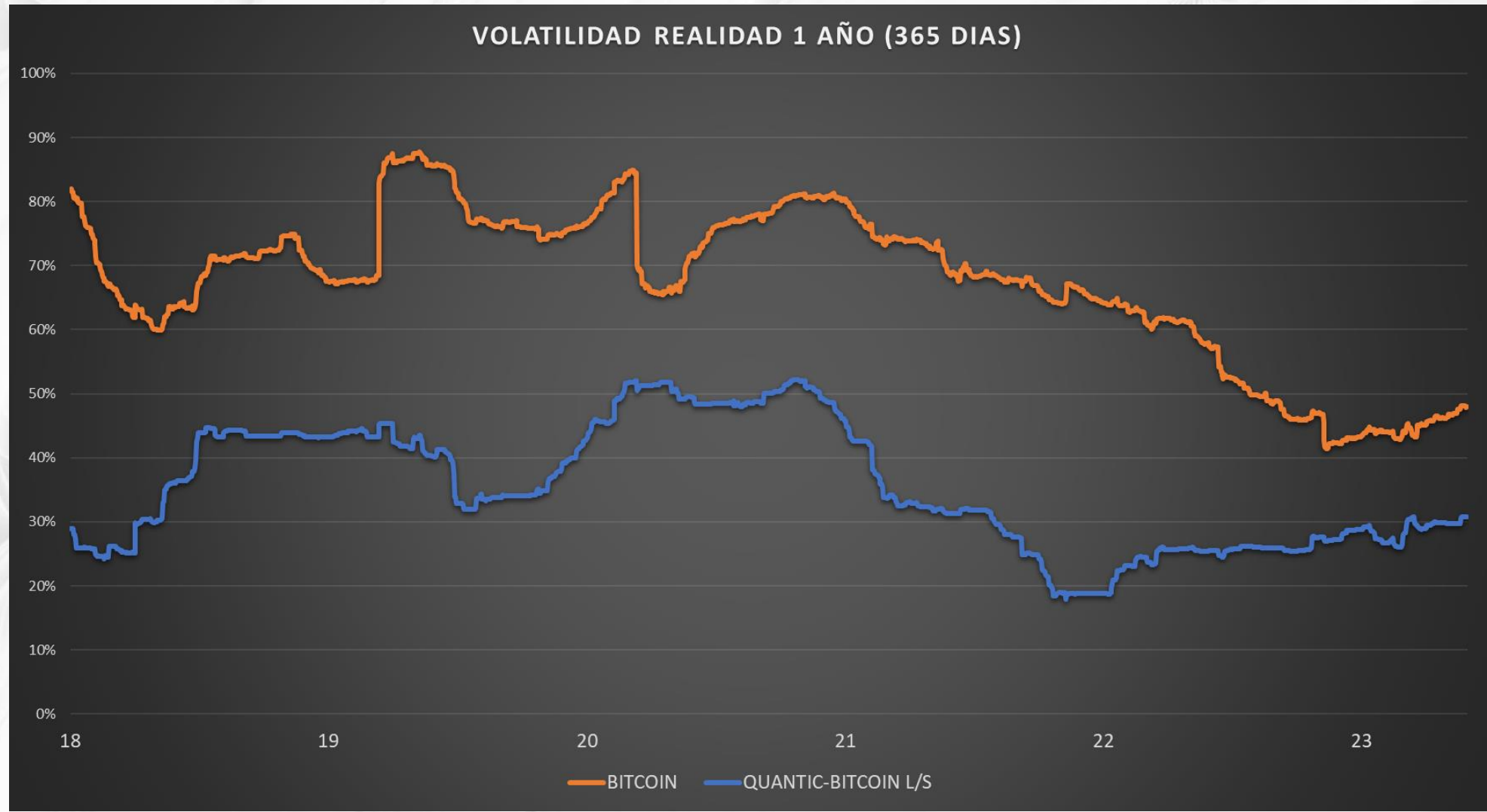
ANALISIS RIESGOS



PERDIDAS MAXIMAS



VOLATILIDAD REALIZADA



MINIMO RENDIMIENTO ACUMULADO ANUALIZADO

