

Портфель Quantix

Анализ эффективности и архитектура алгоритма



Конфиденциальный отчет для
стратегических партнеров

Бескомпромиссная генерация Альфы

25.02%

Среднегодовой темп роста (CAGR)

2.57

Коэффициент Шарпа (Sharpe Ratio)

\$496,956

Общая чистая прибыль

1.63

Фактор прибыли (Profit Factor)

Общая доходность: **62.12%**

Историческая устойчивость (2018–2026)



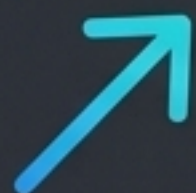
Непрерывный и устойчивый рост капитала на протяжении всего периода тестирования.

Превосходство над эталоном рынка

Стратегия Quantix

Доходность:

25.02%



Макс. Просадка:

6.06%



S&P 500 (Бенчмарк)

Доходность:

7.05%

Макс. Просадка:

34.26%



При одинаковом уровне риска, алгоритмическая система генерирует в разы больше капитала.

Сёрфинг на глобальном моментуме



100% Long Bias

(Исключительно длинные позиции)

Точность алгоритма



Винрейт (Точность входов):

58.02%



Средняя прибыль на сделку:

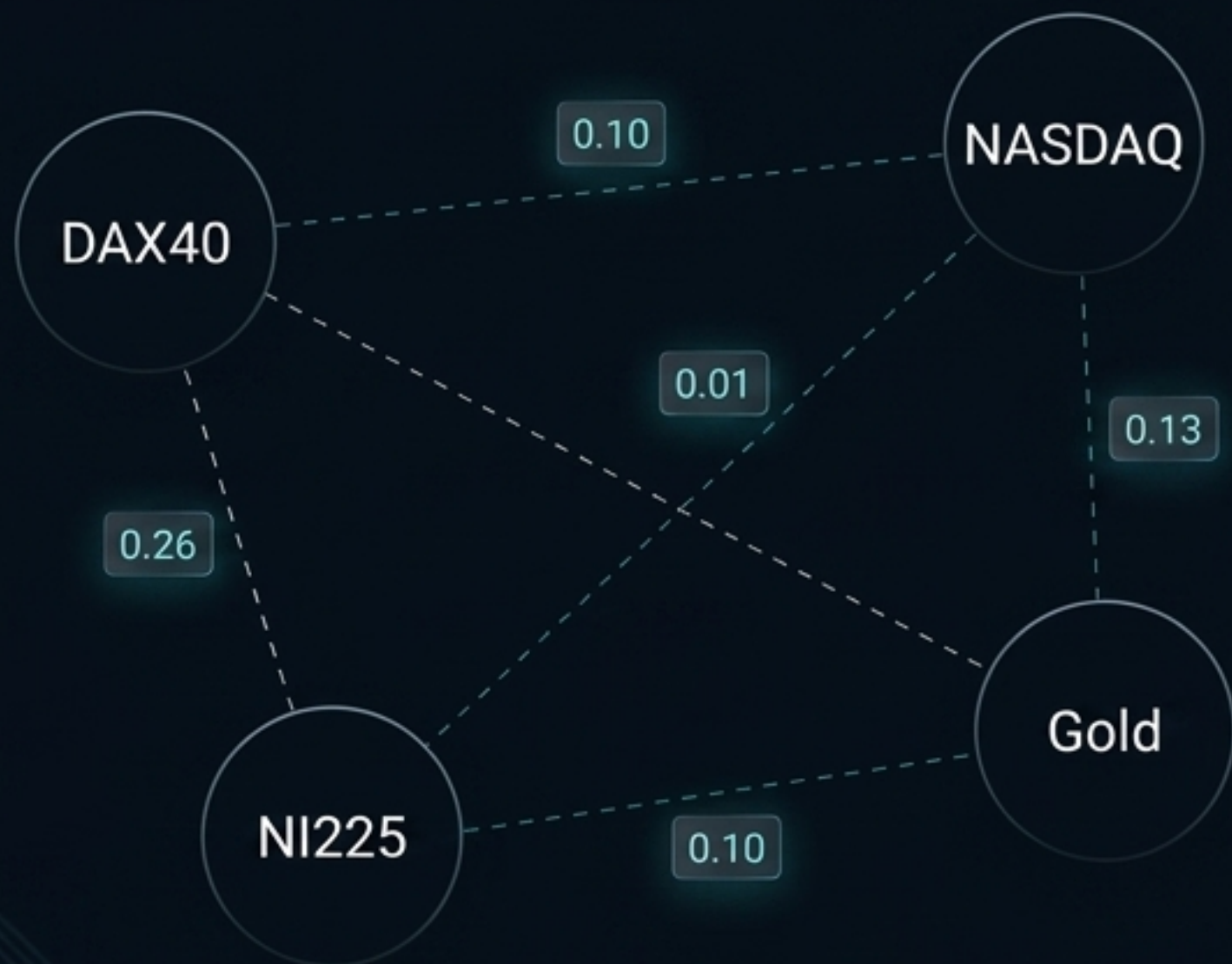
\$174.43



Захват максимальной ликвидности: основная активность алгоритма сосредоточена в Европейскую и Американскую торговые сессии.

Независимые источники прибыли

Asset Constellation



Критически низкая корреляция активов

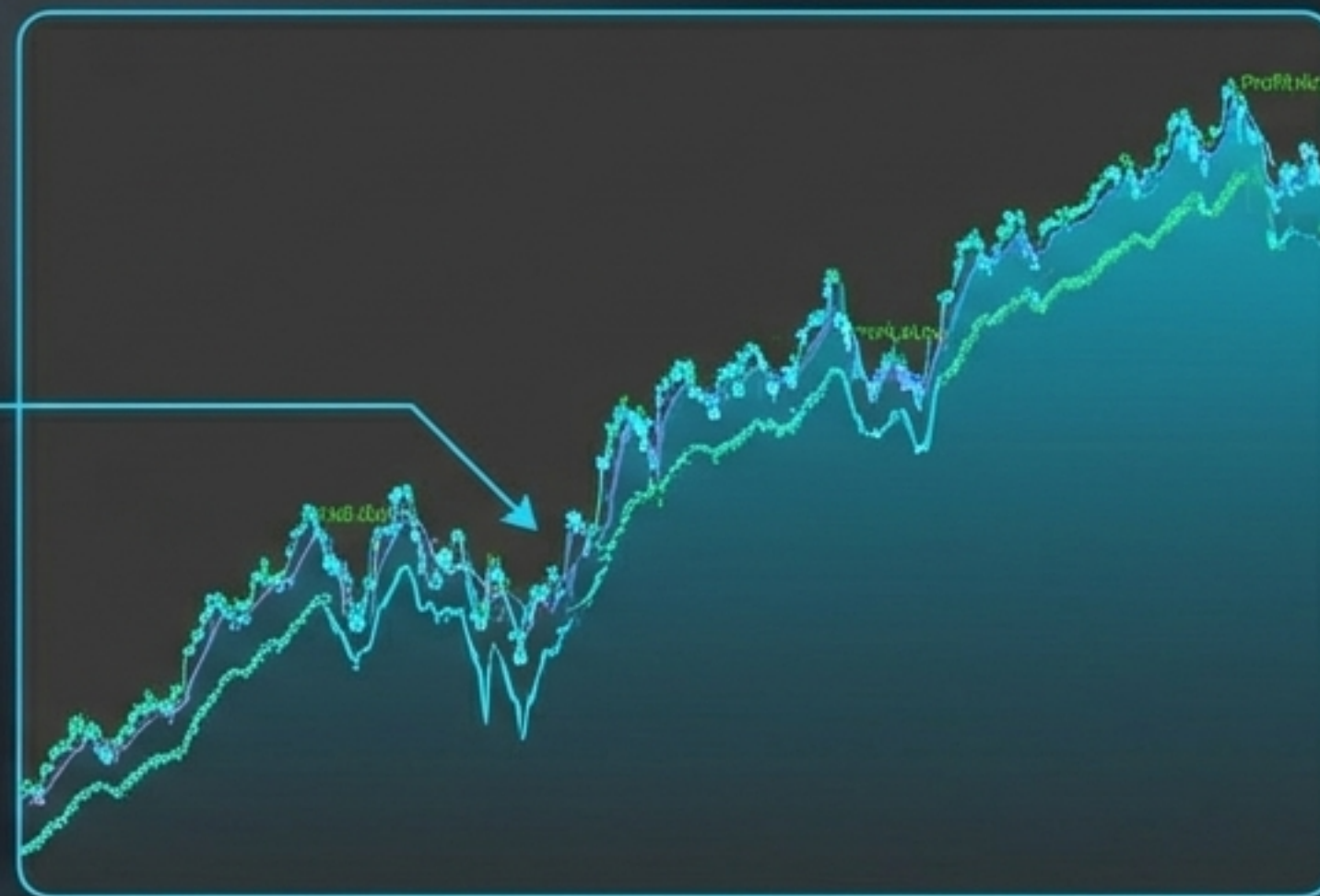
Коэффициенты взаимосвязи от 0.01 до 0.26 доказывают, что рынки торгуются независимо друг от друга.

Результат: Диверсификация, которая математически снижает общий риск портфеля.

Архитектура защиты капитала

6.06%

Максимальная историческая
просадка (Max Drawdown)

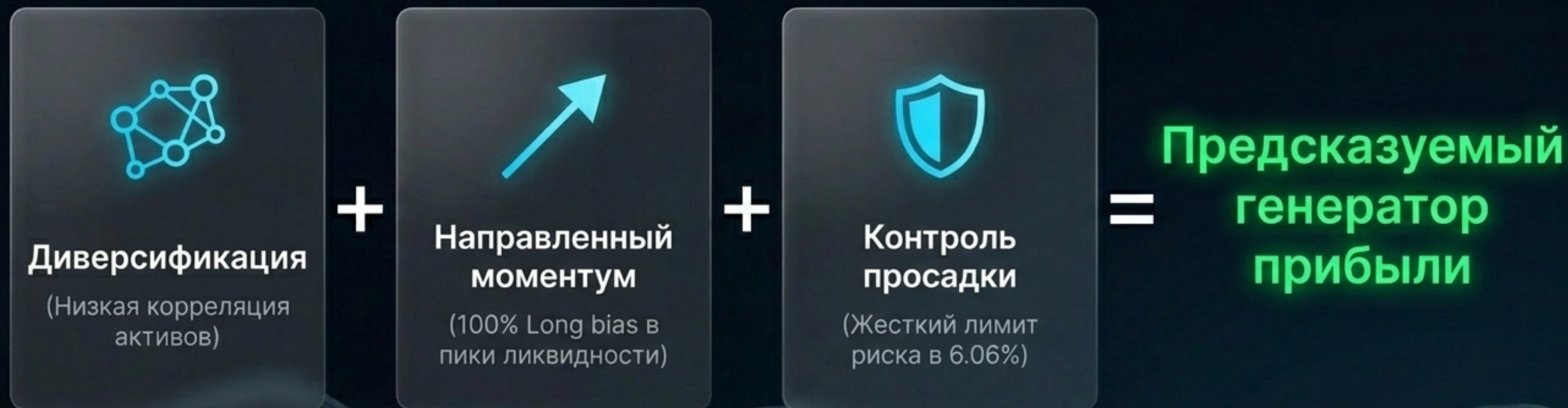


Отсутствие резких падений

Жесткий алгоритмический
контроль объемов

Стабильная кривая эквити

Уравнение масштабируемой Альфы



Система разработана как целостный механизм, исключающий человеческий фактор и случайность.

Стратегическое партнерство

Абсолютная масштабируемость:
алгоритм готов к управлению крупным
институциональным капиталом.

Возможности: Прямое инвестирование,
лицензирование, интеграция в family offices.



Code. Backtest. Execute.

Email:
info@algotradesystems.pro

Telegram:
[@UnicornFX](https://t.me/UnicornFX)