ALGORITMICA.pro

Conto Pilota

Real money portfolio // 15-Month track record

Initial capital (06/2016): **€ 219,637.96**

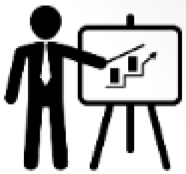
Cumulative Net Result: **€ 42762.46** Net of commission

Cumulative Net Result: **19.47%** Net of commission

Max. drawdown: **€ 10066**

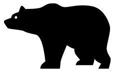
Max. drawdown: **4,58%**

Strategies



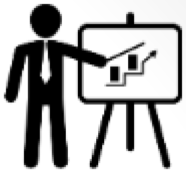
- **Systematic Diversified** portfolio
- **More active Trading Systems + several under study**
- **Not *High Frequency Trading*** → **(~ 60% Intraday ~ 400% Daily)**
- **Liquid instruments** → **Futures on Indexes, Currency, Options, Stocks,Etf**

  → **High scalability**
- **Profits** on both **bullish** and **bearish markets**



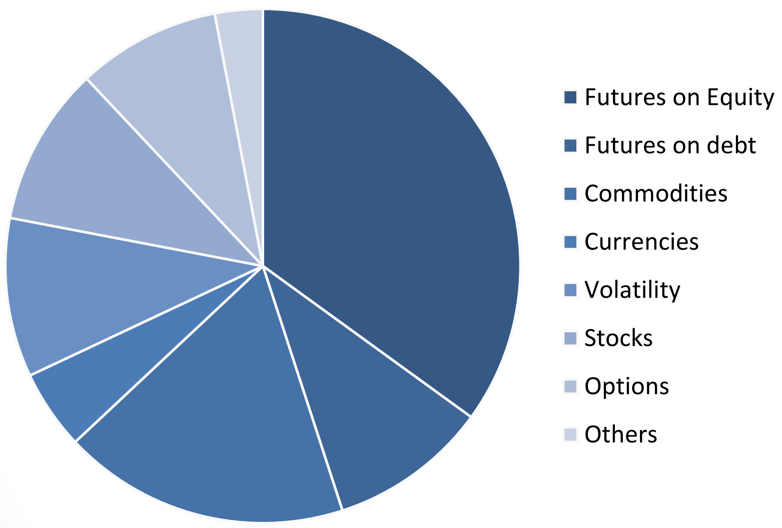
ALGORITMICA.pro

Strategies



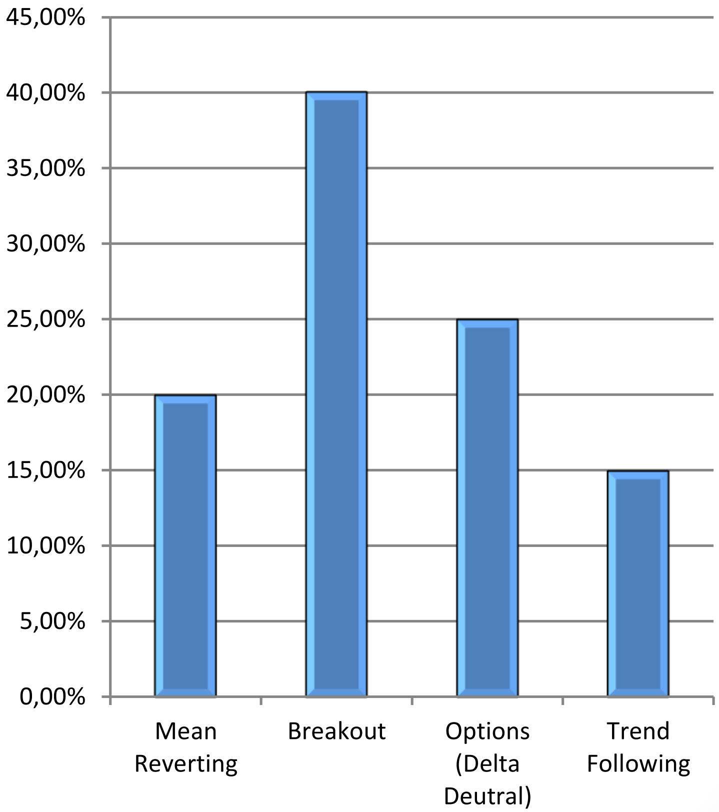
<u>Calcolato sul numero di operazioni</u>

Portfolio Composition



<u>Inseriti 'discrezionalmente'</u>

Strategies Logic



Risk Management

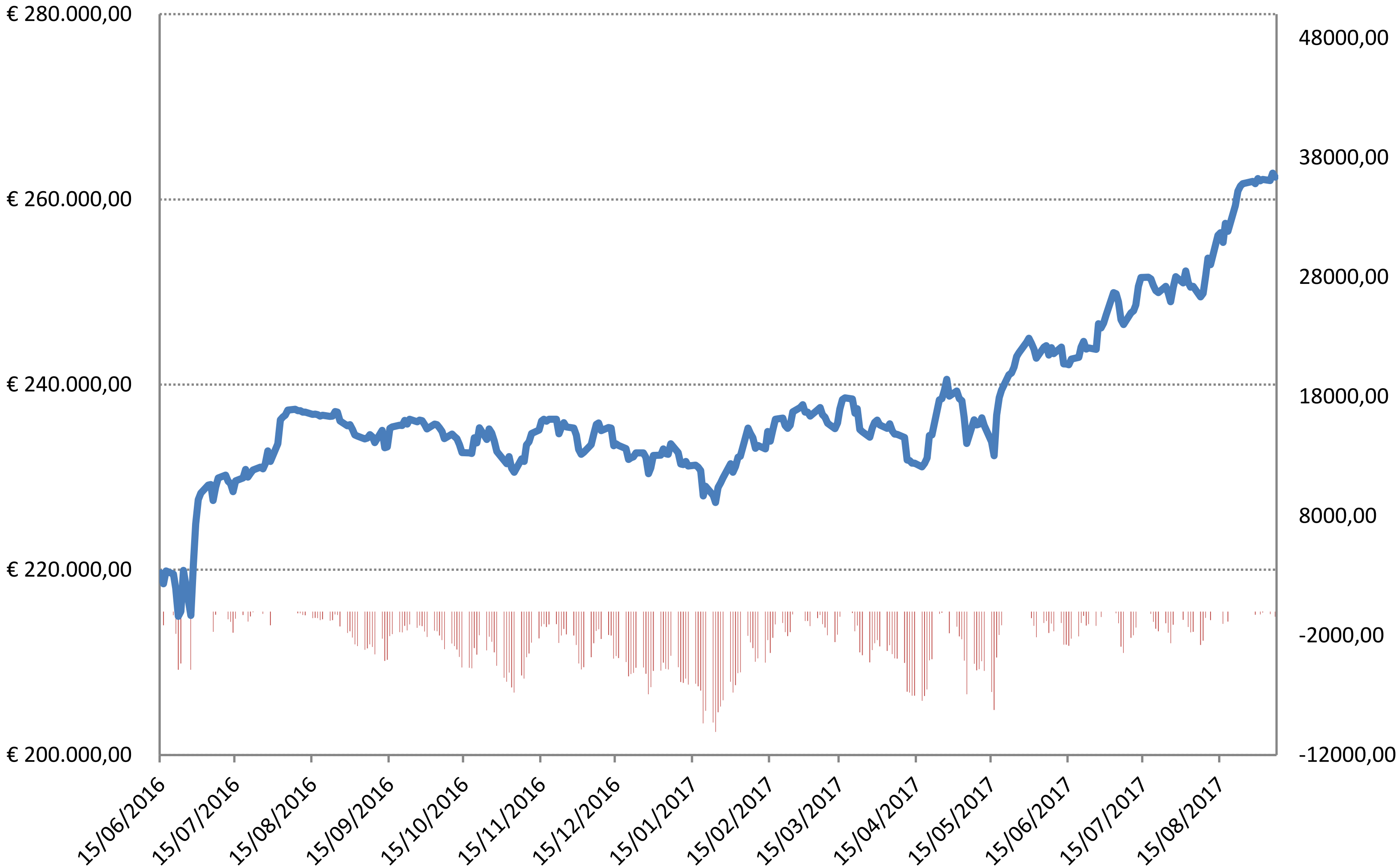
- **Risk and reward expectation** of our pilot portfolio are **customizable**

- Strict money management rules
  - **Dynamic position sizing notional value based**
  - **Dynamic position sizing Volatility based**
  - **No *martingale*** or high risk strategies

- **Proprietary algorithms** for the **prevention of TS decay**

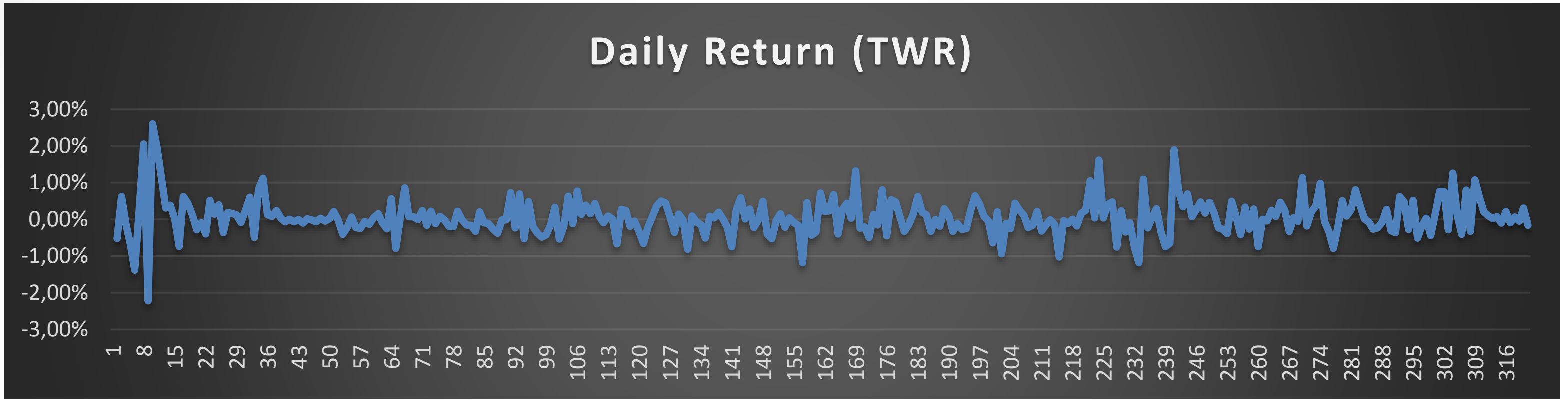
- **Volatility based filters (options strategies)**

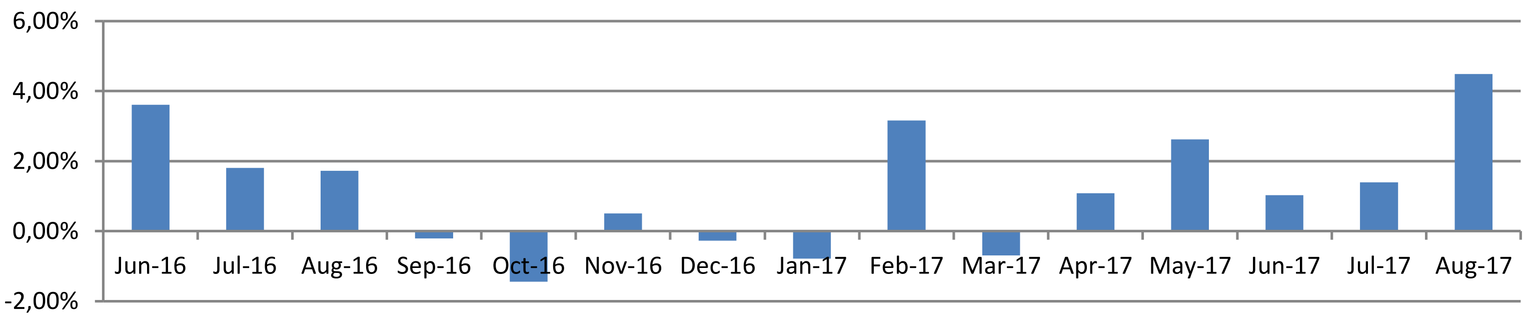
Portfolio Performance



ALGORITMICA.pro

Portfolio Performance



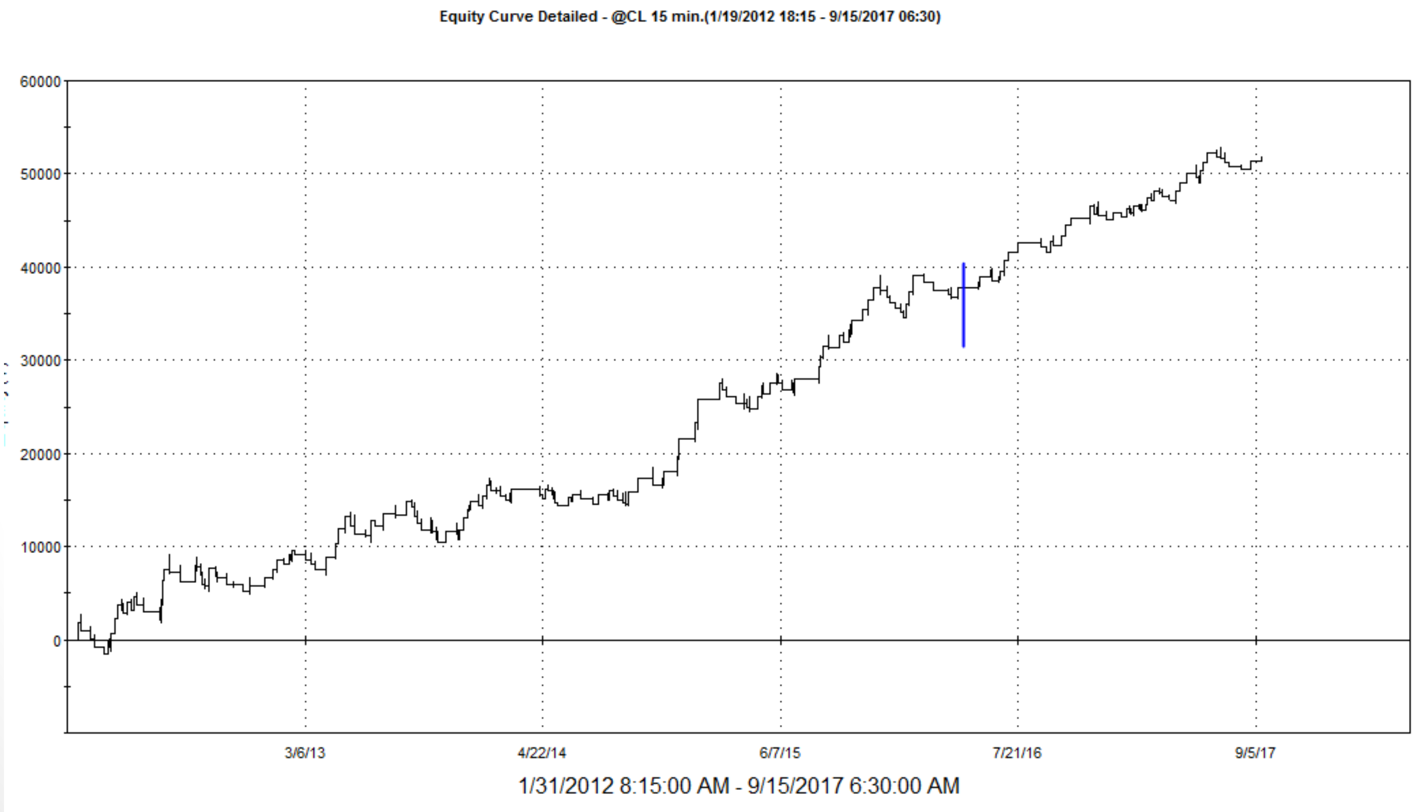


	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Cumulative
2012	-	-	-	-0.18%	-3.87%	12.15%	0.92%	-0.67%	-4.41%	3.04%	10.85%	5.27%	23.10%
2013	4.05%	24.26%	6.17%	11.19%	-17.07%	11.89%	-11.81%	-0.06%	15.98%	11.70%	3.40%	6.63%	66.32%
2014	-4.26%	1.69%	8.12%	9.61%	2.19%	-2.81%	6.36%	-3.78%	3.40%	10.19%	7.87%	-3.00%	35.58%
2015	9.80%	2.23%	5.64%	4.57%	15.21%	-9.38%	1.76%	-11.21%	2.45%	0.65%	13.13%	0.35%	35.22%
2016	-0.24%	-2.33%	1.61%	-1.87%	0.75%	3.61%	1.81%	1.73%	-0.21%	-1.45%	0.51%	-0.27%	3.65%
2017	-0.79%	3.16%	-0.69%	1.09%	2.62%	1.03%	1.40%	4.49%					12.31%

ALGORITMICA.pro

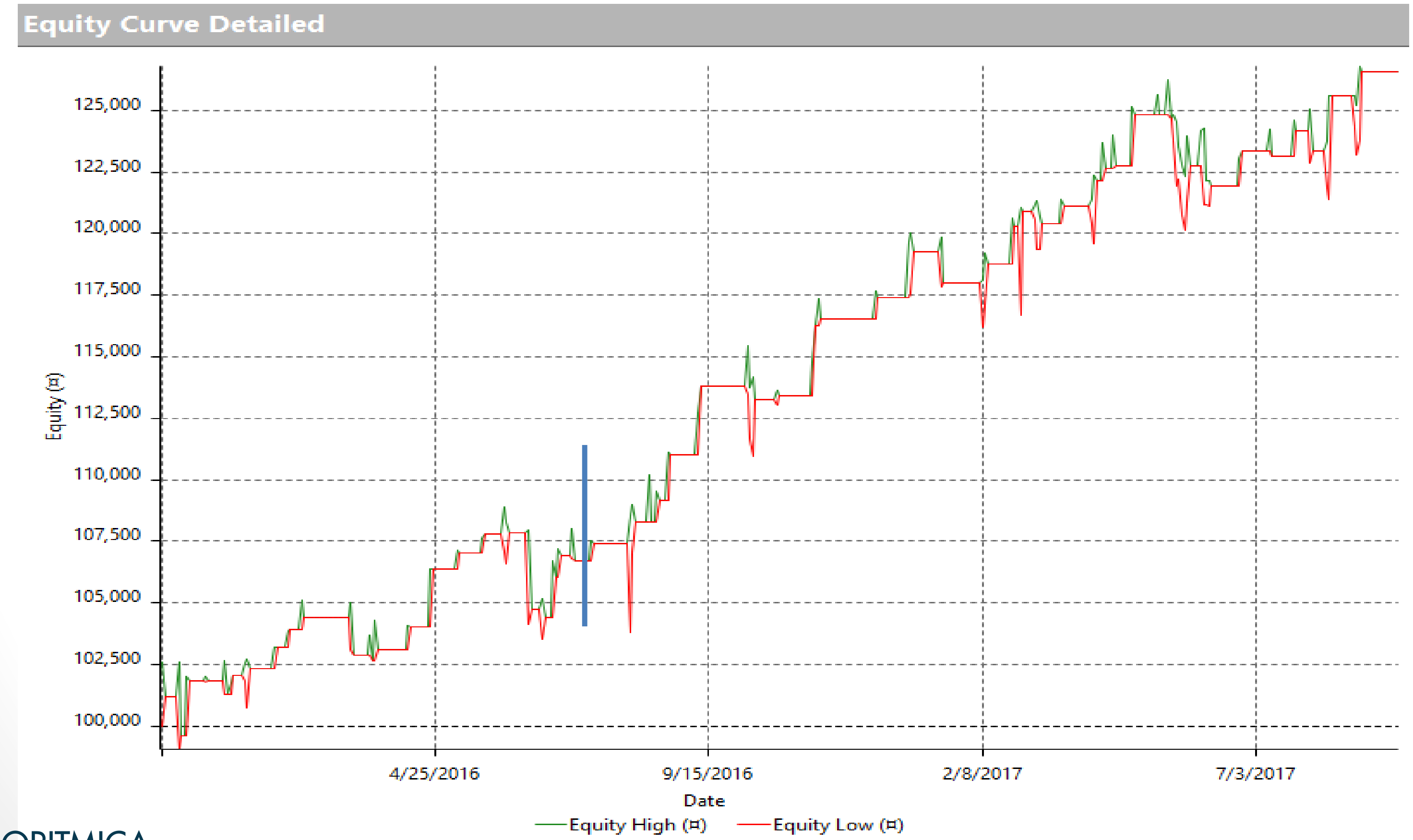
Best Trading Systems from Jun 2016

- Prime CL
  - Net Profit $ 13020
  - Drawdown $ 2150



Best Trading Systems from Jun 2016

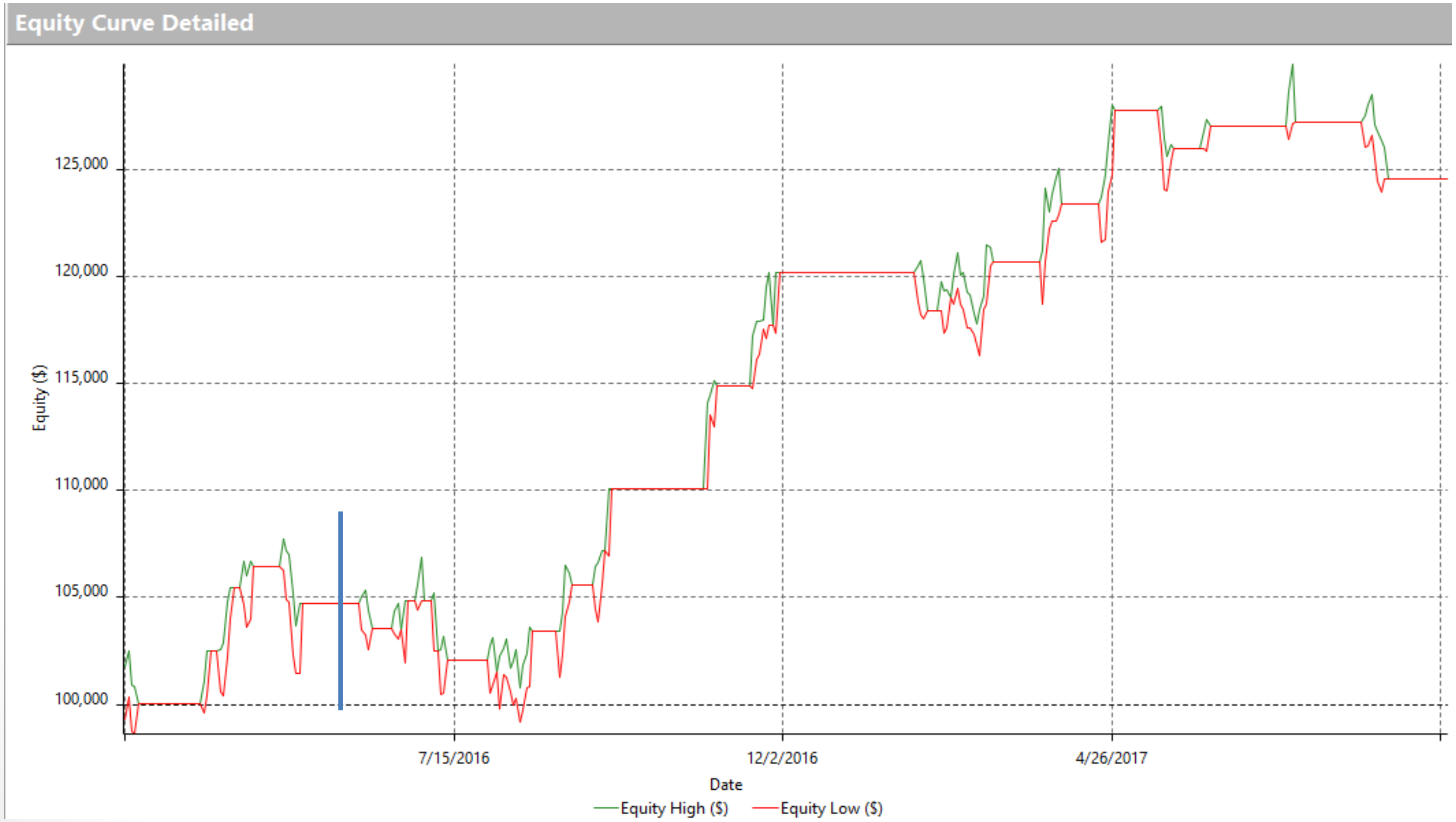
- BB KC
  - Net Profit $ 19518
  - Drawdown $ 2888



ALGORITMICA.pro

Best Trading Systems from Jun 2016

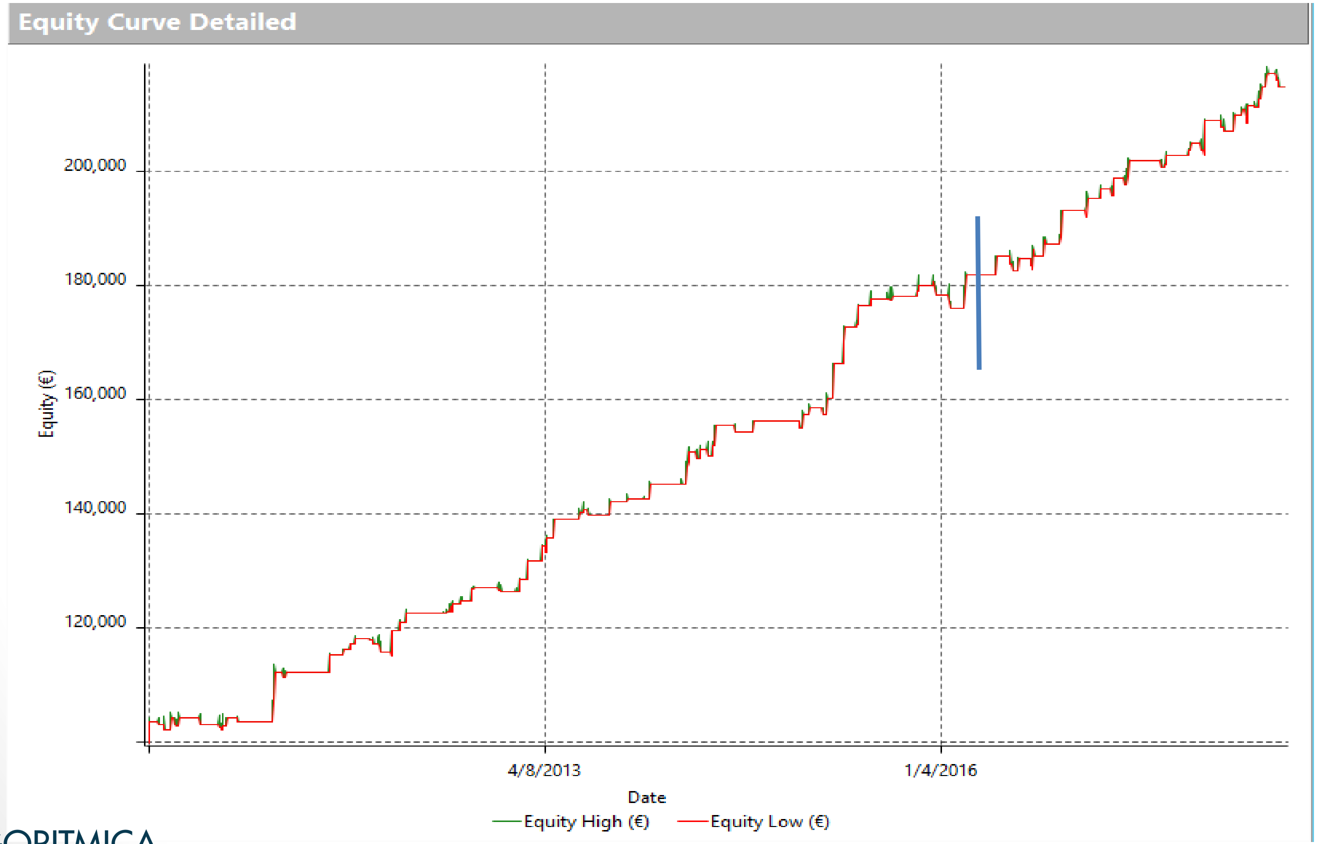
- Olap RB
  - Net Profit $ 19832
  - Drawdown $ 5255



ALGORITMICA.pro

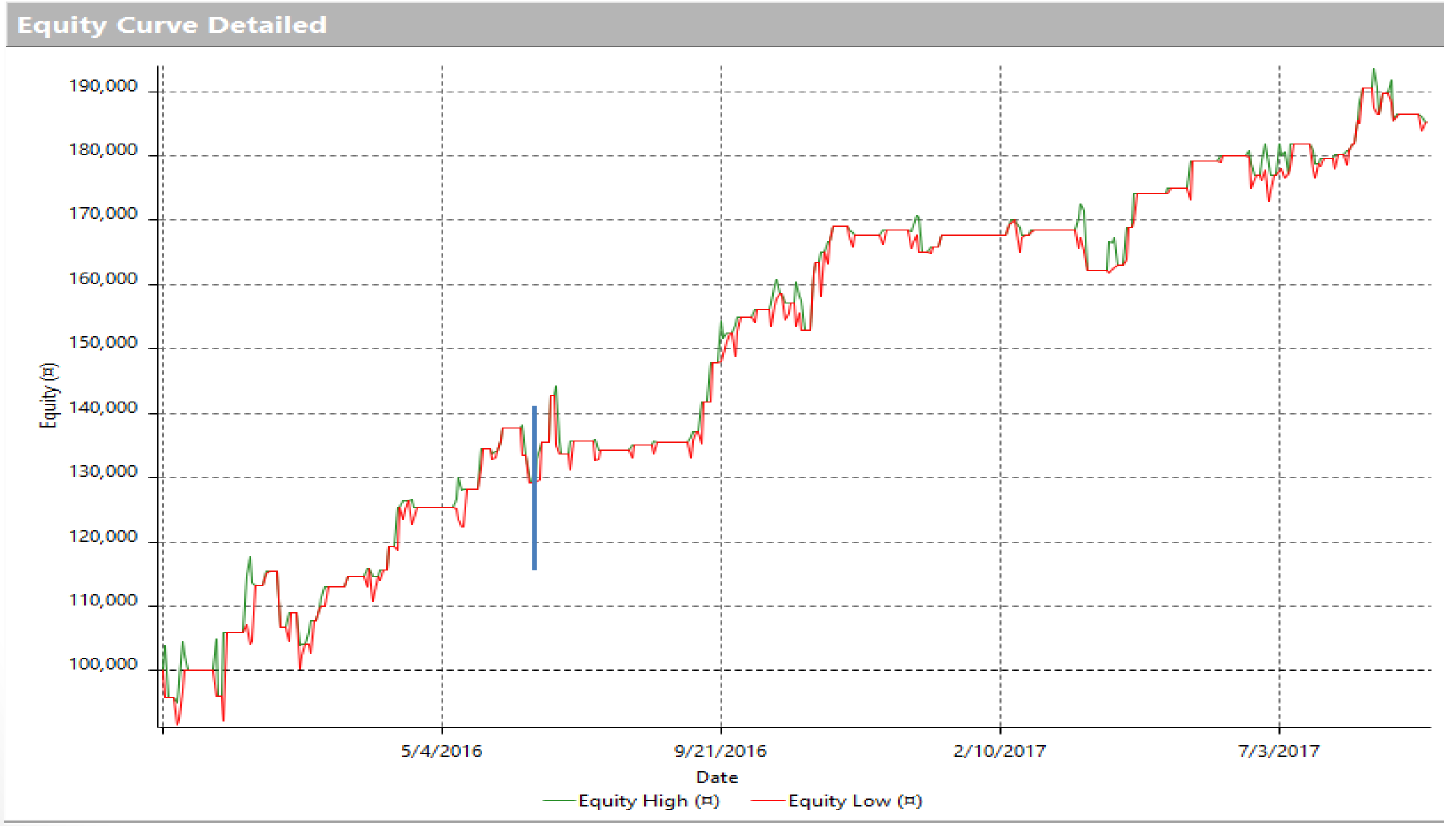
Best Trading Systems from Jun 2016

- Equity Hunter DAX (in reale tradato su 2 contratti mini)
  - Net Profit $ 30120
  - Drawdown $ 3275



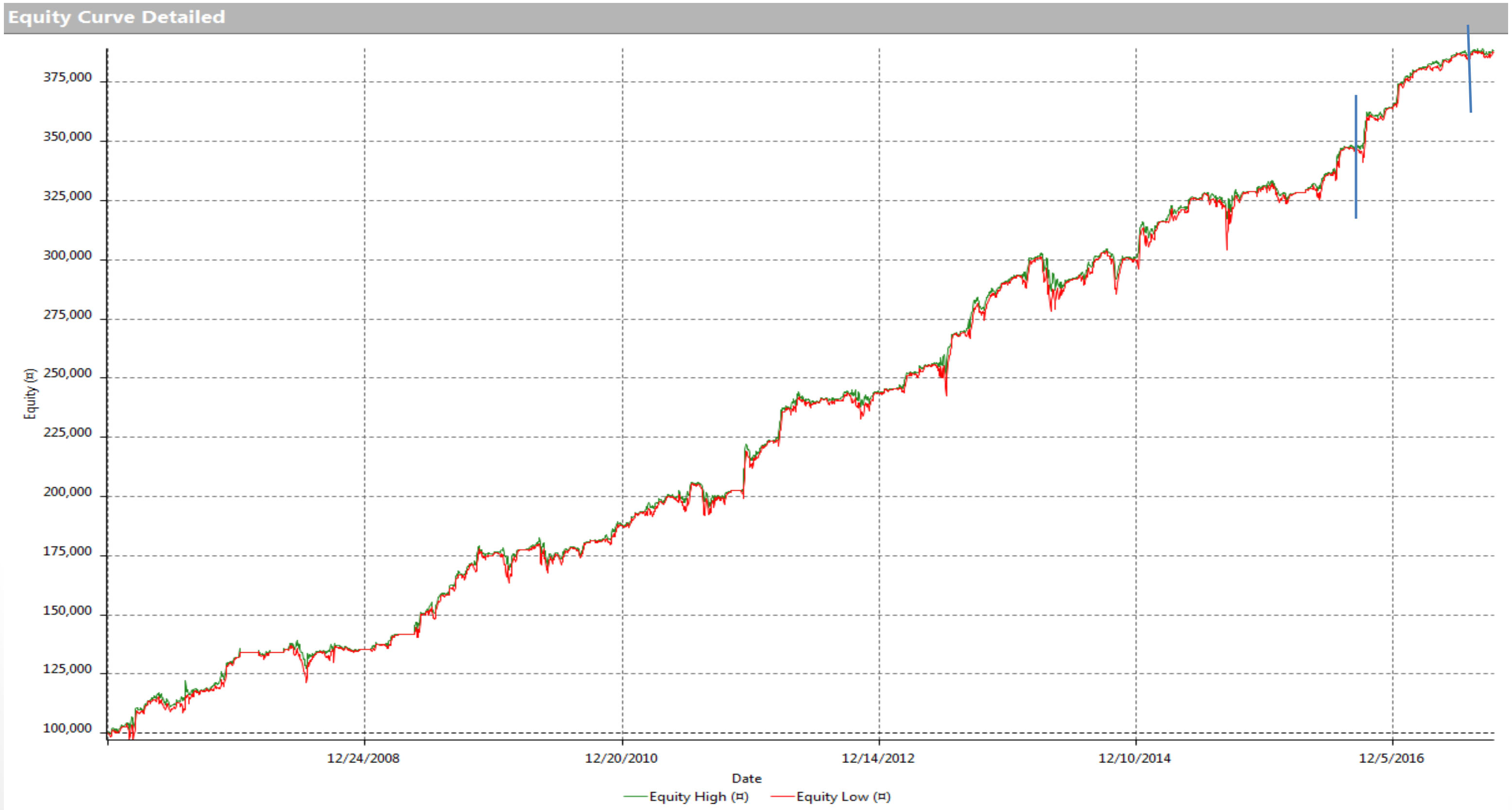
Best Trading Systems from Jun 2016

- Driftin ES (nel report 6 contratti, in reale 1 contratto)
  - Net Profit $ 51225
  - Drawdown $ 10425



Best Trading Systems from Jun 2016

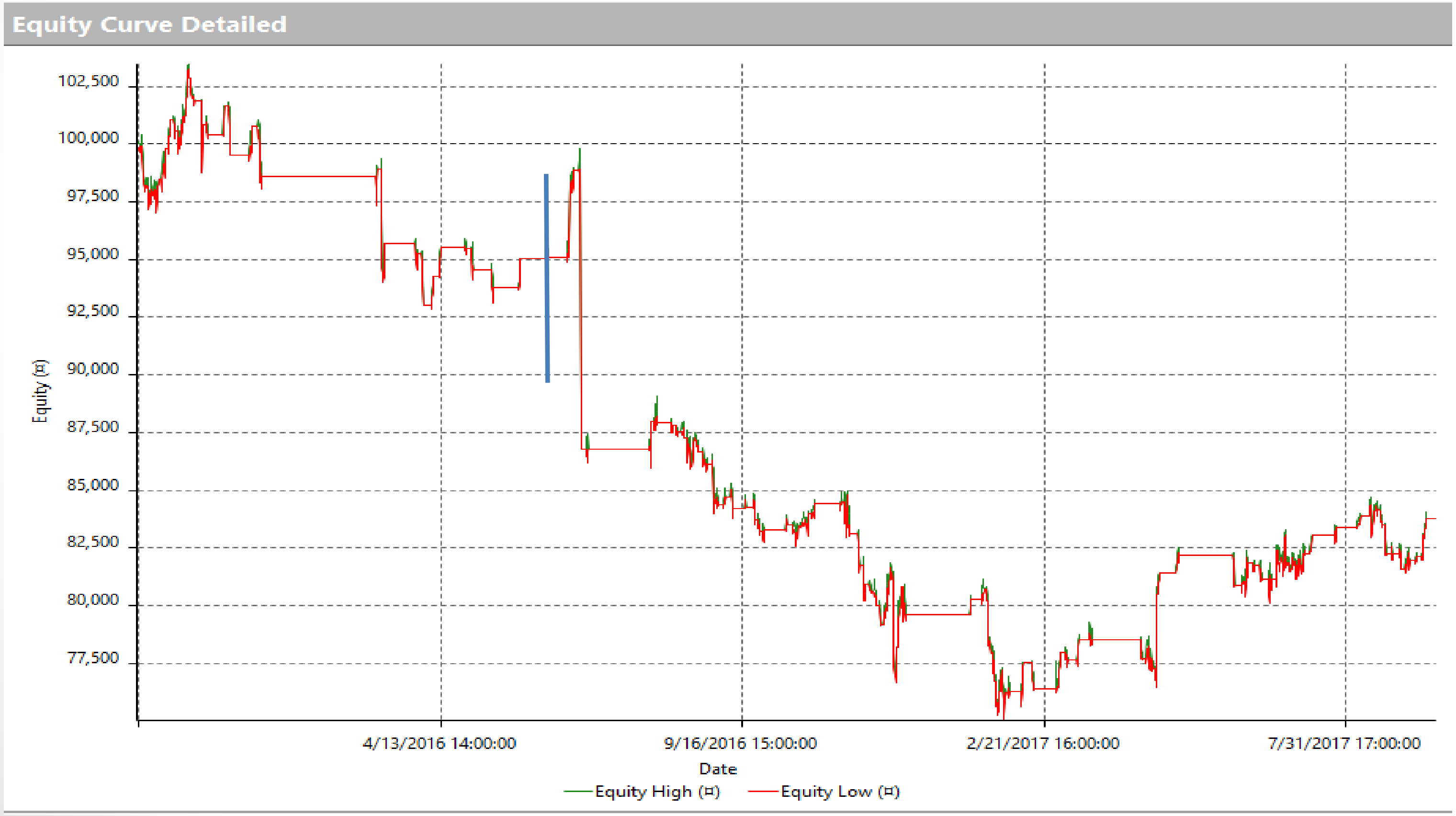
- MCVI Azionario Nasdaq 1000 (attivo solo da luglio 2017, out of sample da oltre 3 anni)
  - Net Profit $ 2263
  - Drawdown $ -1724



ALGORITMICA.pro

Worst Trading System from Jun 2016

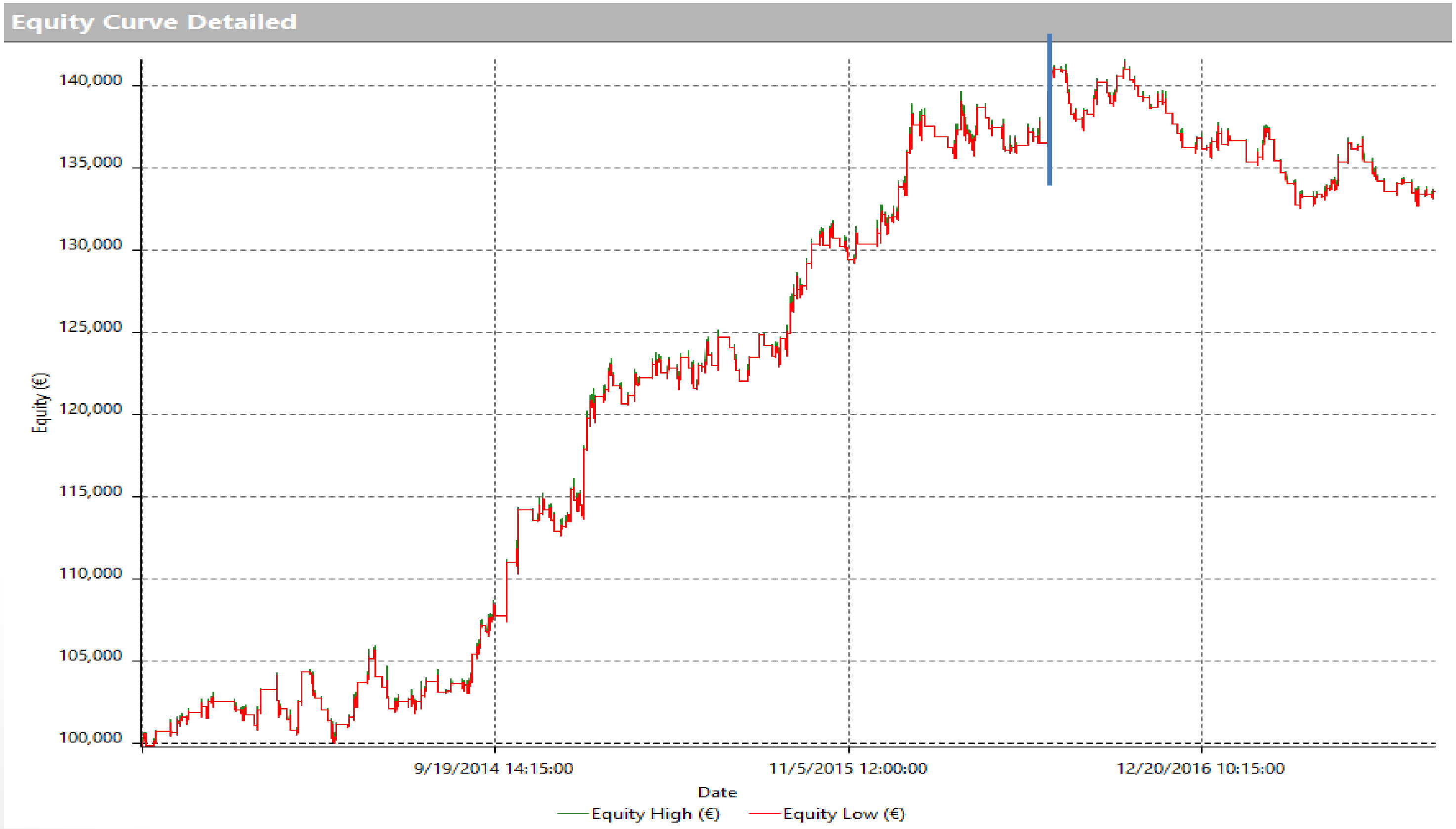
- Flipper II Fib intraday
  - Net Profit € -11245
  - Drawdown € 23550



ALGORITMICA.pro

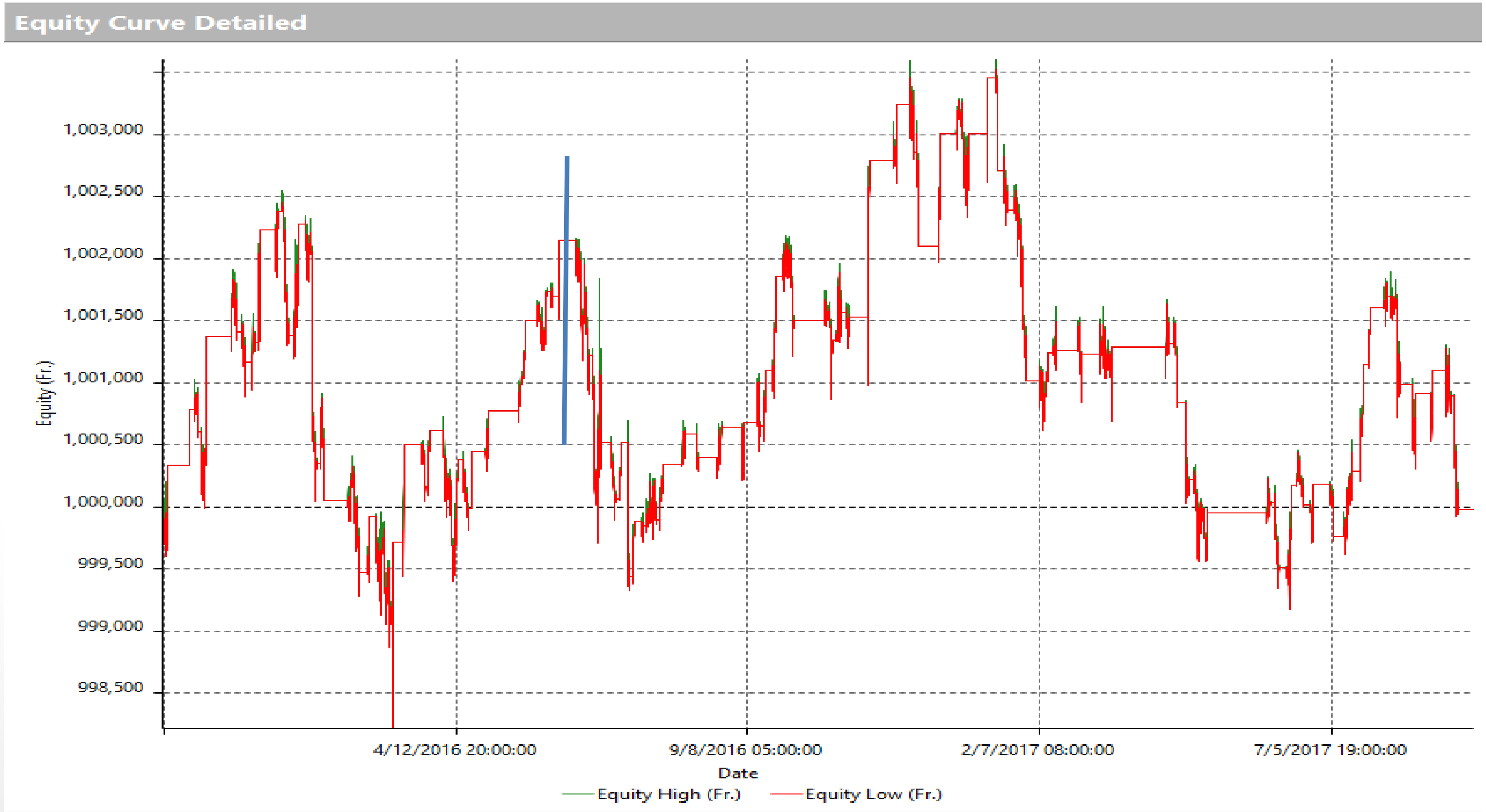
Worst Trading System from Jun 2016

- Brunch Fib
  - Net Profit € -8450
  - Drawdown € -10275



Worst Trading System from Jun 2016

- Pacman USD CHF
  - Net Profit Fr -2166
  - Drawdown Fr 4256



ALGORITMICA.pro

Workshop Algoritmica

Metodologie e tecniche per la creazione di un robusto sistema di trading

Andrea Angiolini
Amministratore

Francesco Placci
Ricerca e sviluppo algoritmica.pro

Workshop Algoritmica

- Scopo del workshop: insegnare ai partecipanti il procedimento utilizzato da Algoritmica per la creazione di un robusto sistema di trading.
- Punto di arrivo del percorso formativo offerto da Algoritmica, che si sviluppa a partire dal corso Diventare Quant e successivamente attraverso il corso di programmazione.
- Premessa importante, non troverete regole e indicatori magici, se vi spettate questo potreste rimanere delusi.
- Quello che vi offriamo è una metodologia robusta e consolidate nel tempo. Non esiste il Sacro Graal nel trading!
- La buona notizia<u>: è sufficiente procedere con la giusta metodologia e utilizzare correttamente gli strumenti che sono a disposizione dei trader per giungere alla creazione di un buon trading system.</u>
- Verranno mostrati ai partecipanti i nuovi strumenti di validazione ideati da Algoritmica tra cui il software Validator con licenza life-time.
- Il fine ultimo del workshop è mettere i discenti nelle condizioni di creare autonomamente i loro sistemi di trading.
- Verranno infine offerti ai partecipanti alcuni di sistemi che Algoritmica usa quotidianamente per la sua attività di trading.
- Infine abbiamo previsto un periodo di follow-up in cui assieme si cercherà di sviluppare nuovi sistemi di trading partendo da spunti e idee condivise.
- Data 30 Settembre 1 Ottobre in aula a Bologna.

ALGORITMICA.pro

ALGORITMICA.pro

www.algoritmica.pro
info@algoritmica.pro
051.3760999