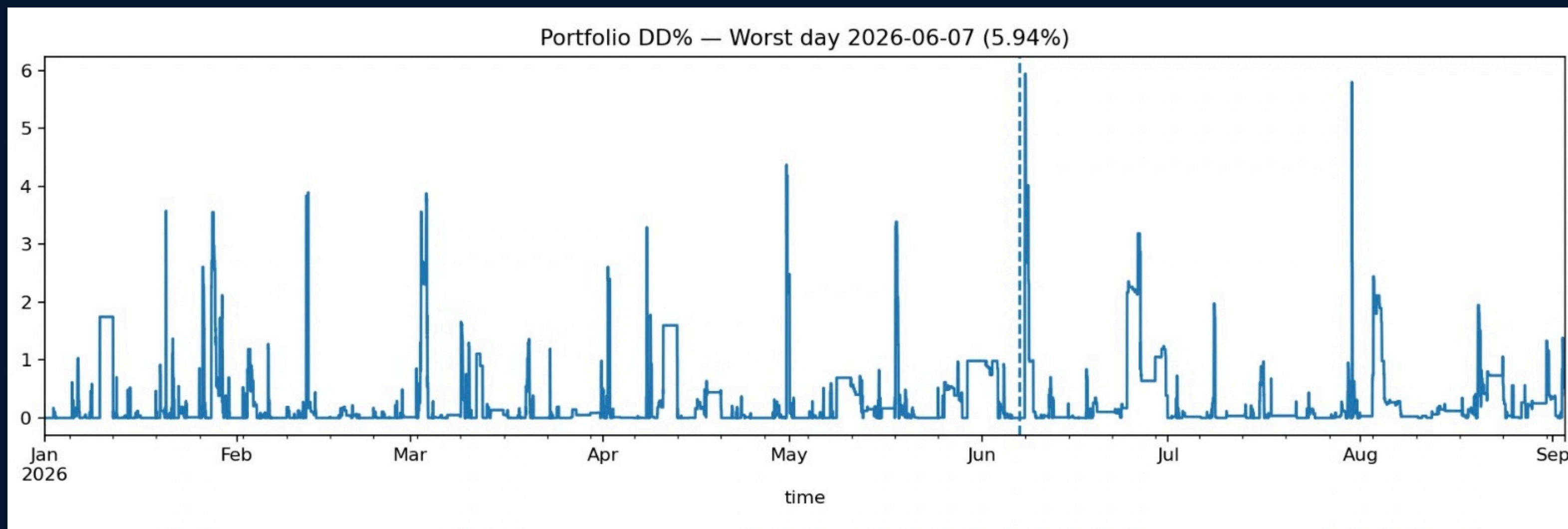




ACOFI

We finance your energy

Nuova strategia “Diamond”



+36.93%

Performance

**01-01-2026
31-08-2026**

Periodo analizzato

5.94%

Relative Drawdown

DIAMOND — Evoluzione del sistema

DIAMOND rappresenta la nuova evoluzione del nostro sistema di trading algoritmico.



L'architettura è stata ampliata da 62 a 80 Expert Advisor, con l'integrazione di **18 nuovi EA** progettati per aumentare ulteriormente la diversificazione e l'efficienza complessiva del sistema.

Gli 80 Expert Advisor operano attraverso timeframe differenti e su un universo di strumenti particolarmente ampio:

- **Mercato Forex:** operatività sull'intero paniere di coppie valutarie previste dal sistema
- **S&P 500:** esposizione al principale indice azionario statunitense
- **DAX:** esposizione al mercato azionario tedesco
- **Oro:** operatività sul mercato del gold

L'utilizzo simultaneo di strategie, strumenti e orizzonti temporali differenti consente a **DIAMOND** di costruire una diversificazione multilivello, riducendo la dipendenza da una singola strategia o da uno specifico mercato.

QUANT ANALYZER PORTFOLIO REPORT

Portfolio

TOTAL PROFIT

\$ 369305.38

PROFIT IN PIPS **175432325.5 PIPS**

YRLY AVG PROFIT **\$ 492405.5**

YRLY AVG % RET **49.24 %**

CAGR **36.93 %**

OF TRADES

2944

SHARPE RATIO

0.25

PROFIT FACTOR

1.92

RETURN / DD RATIO

49.74

WINNING %

62.13 %

DRAWDOWN

\$ 7425.08

% DRAWDOWN

0.56 %

DAILY AVG PROFIT

\$ 1532.39

MTHLY AVG PROFIT

\$ 41033.93

AVERAGE TRADE

\$ 125.44

ANNUAL % / MAX DD%

65.95

R EXPECTANCY

0.35 R

R EXP SCORE

1364.87 R

SQN

14.18

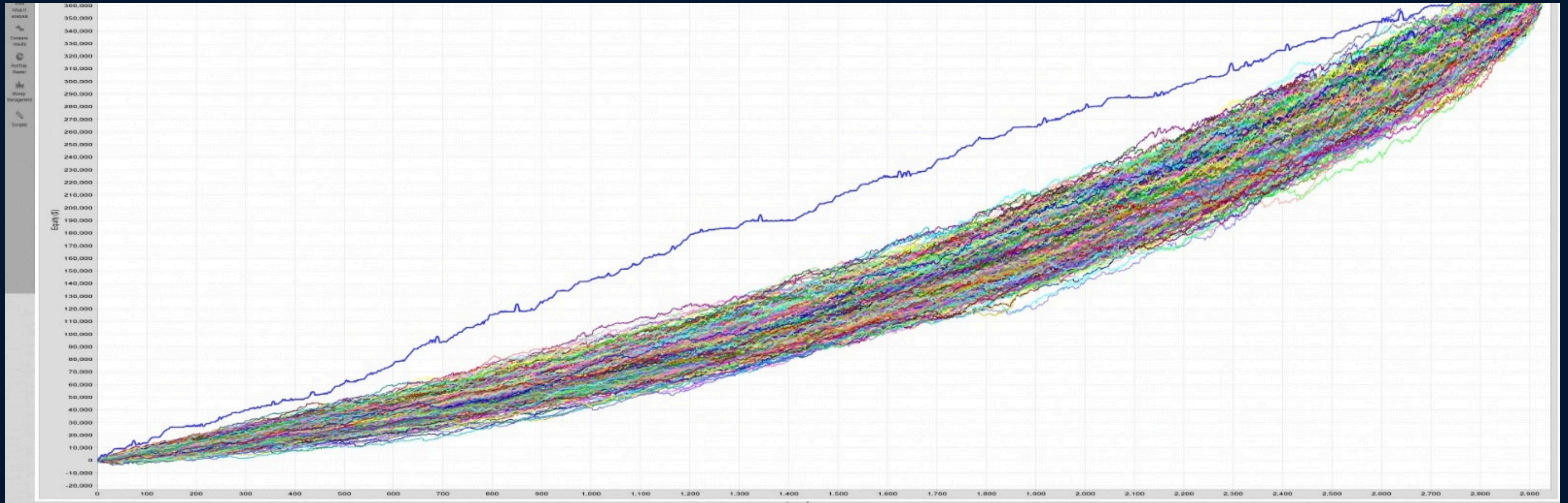
SQN SCORE

109.87

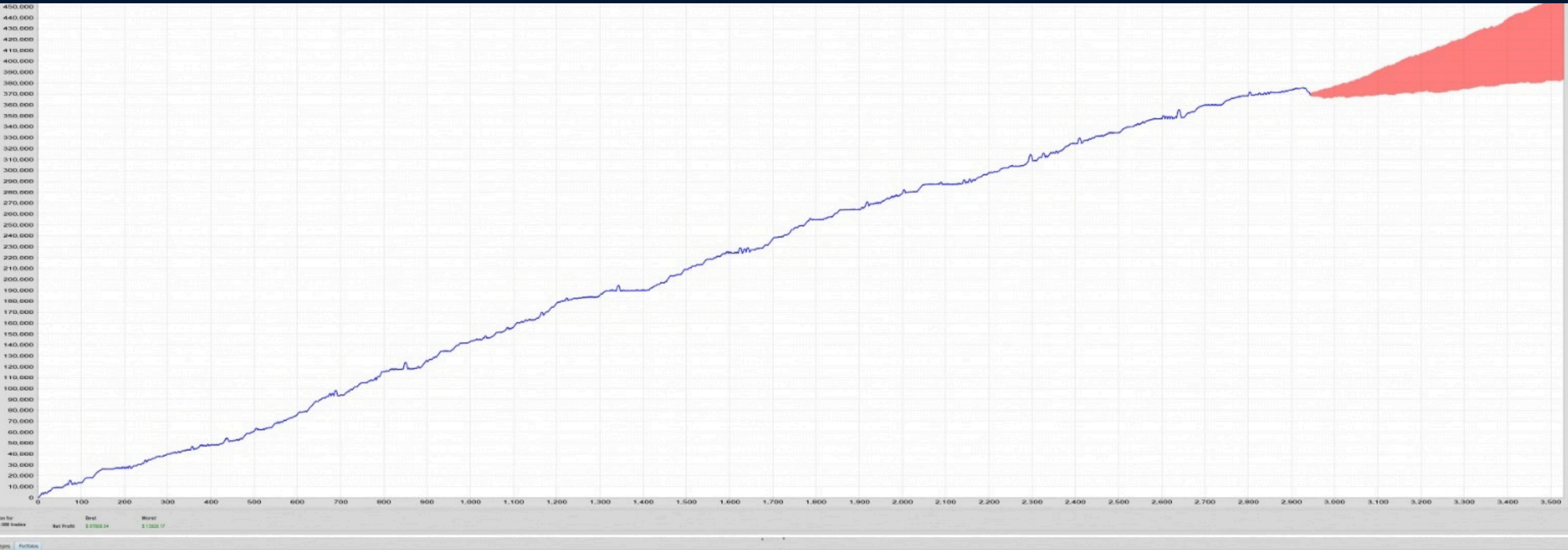
generated by Quant Analyzer

Qui il report completo

IL NOSTRO GRAFICO DI MONTE CARLO



OUT-OF-SAMPLE TEST – VALIDAZIONE DELLA STRATEGIA



Nel grafico della pagina precedente, la linea nera rappresenta l'andamento della strategia fino al 31 agosto, data che identifica la conclusione del periodo storico analizzato. A partire dalla linea rossa viene invece rappresentata una simulazione prospettica dei possibili risultati futuri, elaborata sulla base delle caratteristiche statistiche e del comportamento osservato della strategia.

Le simulazioni evidenziano un intervallo di risultati compreso tra **13928,17 nello scenario più conservativo** e **87808,04 nello scenario più favorevole**.

L'elemento di maggiore interesse è che anche lo scenario meno favorevole mantiene un risultato positivo, indicando prospettive incoraggianti in termini di robustezza del modello.



Le simulazioni prospettiche rappresentano scenari statistici e non costituiscono una garanzia di risultati futuri.

80 EXPERT ADVISOR.

PIÙ MERCATI. PIÙ TIMEFRAME. UN UNICO SISTEMA.

Diversificazione algoritmica per opportunità globali.