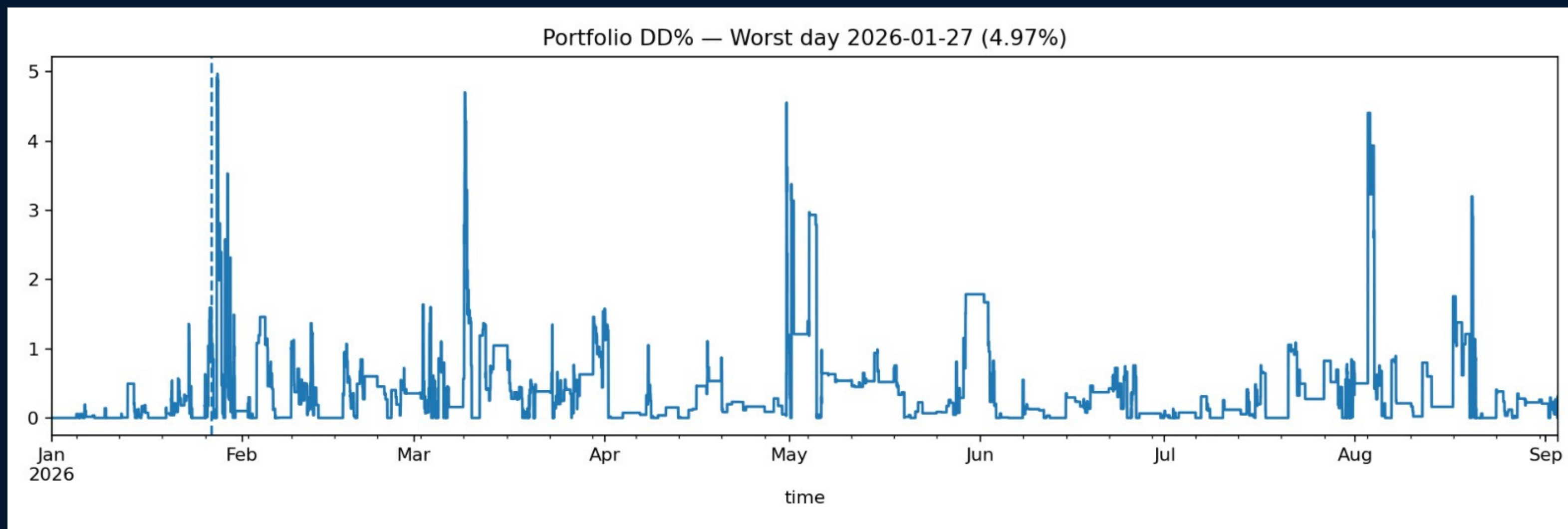




ACOFI

We finance your energy

Aggiornamento strategie Forex
Nuovo portafoglio ACOFI



+21,38%

Performance

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

Periodo analizzato

4.97%

Relative Drawdown

STRATEGIA DI PORTAFOGLIO ACOFI

Il nuovo portafoglio ACOFI nasce dall'integrazione di 62 strategie quantitative, successivamente organizzate e accorpate all'interno di un numero più contenuto di Expert Advisor (EA).

È importante distinguere i due concetti: **il numero di strategie non è stato ridotto.**

L'ottimizzazione ha riguardato esclusivamente l'architettura tecnologica.

Un singolo Expert Advisor è infatti in grado di gestire più strategie operative su timeframe differenti, consentendo di concentrare diverse logiche all'interno dello stesso sistema automatizzato.

In questo modo abbiamo ottenuto una **struttura più efficiente e facilmente gestibile**, mantenendo inalterate le 62 strategie originarie e riducendo solamente il numero di Expert Advisor necessari alla loro esecuzione.

ARCHITETTURA MULTI-PAIR E CONTROLLO DEL RISCHIO



La strategia utilizza un modello multi-pair sul mercato Forex, basato sull'abbinamento di coppie valutarie con dinamiche differenti o tendenzialmente opposte. Il portafoglio opera contemporaneamente su combinazioni, con l'obiettivo di diversificare le esposizioni e contenere il drawdown complessivo.

Le strategie lavorano su timeframe selezionati attraverso analisi quantitative, privilegiando le configurazioni che hanno mostrato il miglior equilibrio tra rendimento, stabilità e rischio.

Questa architettura è particolarmente adatta a **mercati volatili e instabili**, poiché diversifica l'operatività tra più strumenti, strategie e timeframe, riducendo la dipendenza da una singola dinamica di mercato.

QUANT ANALYZER PORTFOLIO REPORT

Portfolio

TOTAL PROFIT

\$ 213774.46

PROFIT IN PIPS 17076.9 PIPS

YRLY AVG PROFIT \$ 320661.69

YRLY AVG % RET 6.42 %

CAGR 4.28 %

OF TRADES

1046

SHARPE RATIO

0

PROFIT FACTOR

2.26

RETURN / DD RATIO

16.04

WINNING %

66.06 %

DRAWDOWN

\$ 13324.48

% DRAWDOWN

0.25 %

DAILY AVG PROFIT

\$ 879.73

MTHLY AVG PROFIT

\$ 26721.81

AVERAGE TRADE

\$ 204.37

ANNUAL% / MAX DD%

17.1

R EXPECTANCY

0.43 R

R EXP SCORE

671.71 R

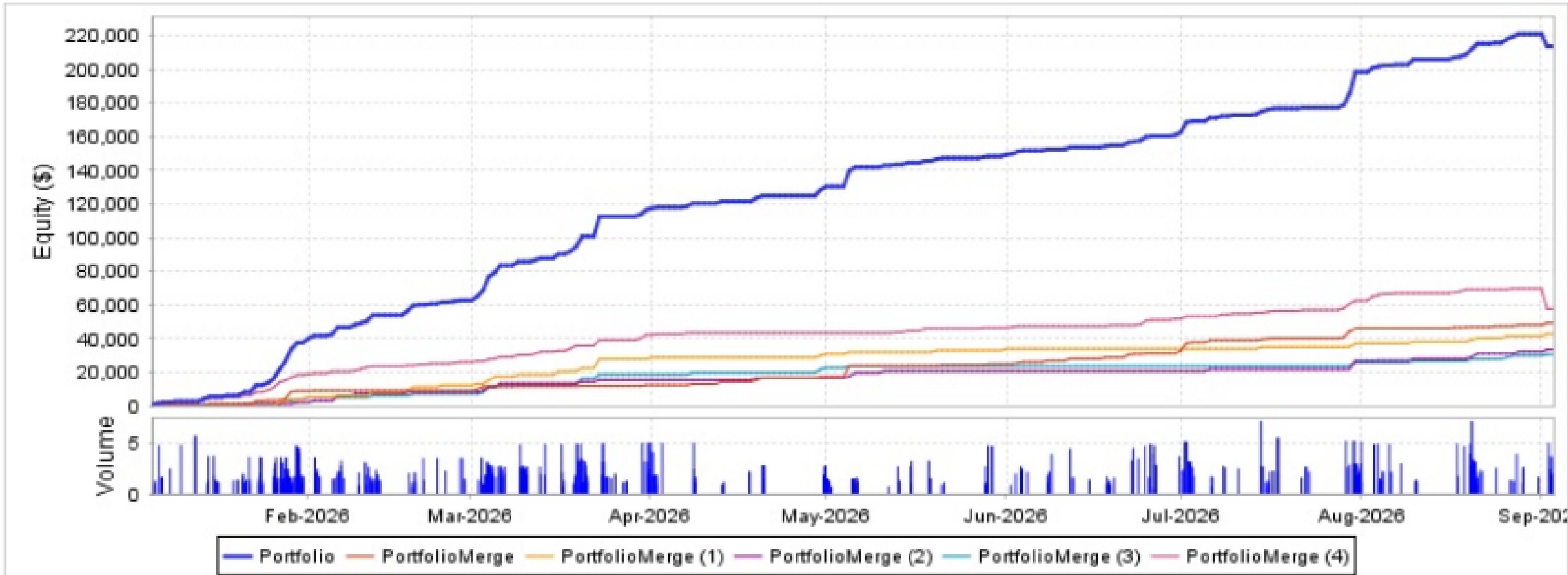
SQN

9.55

SQN SCORE

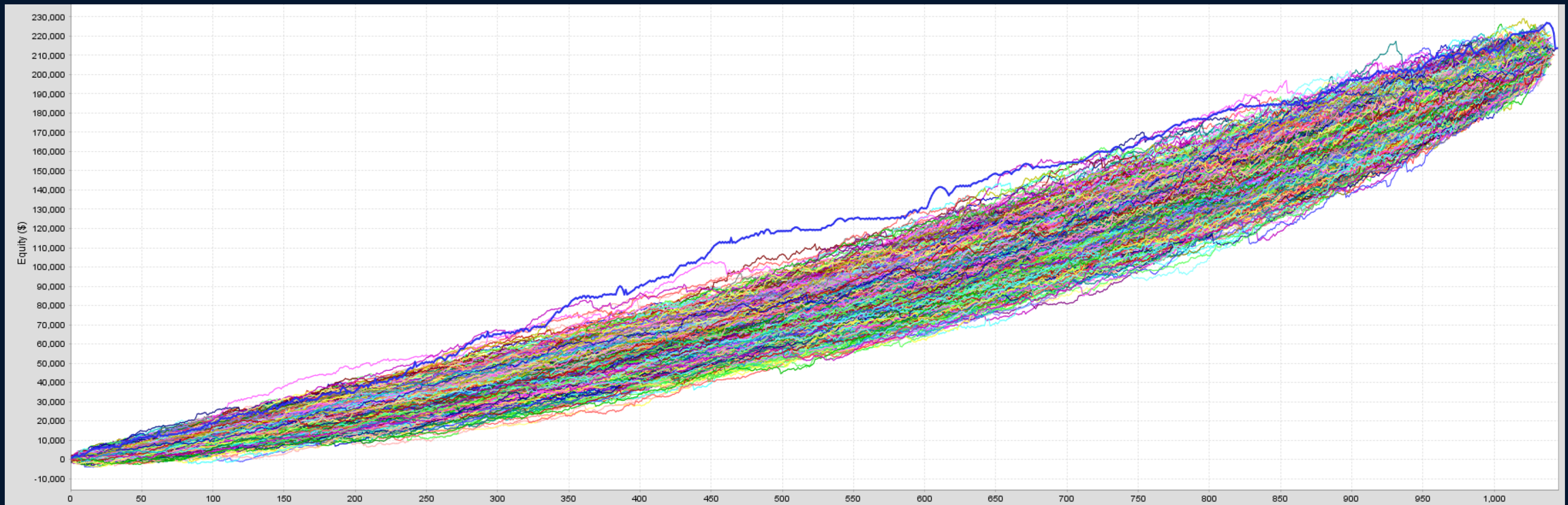
50.52

generated by Quant Analyzer



Qui il report completo

IL NOSTRO GRAFICO DI MONTE CARLO



OUT-OF-SAMPLE TEST — VALIDAZIONE DELLA STRATEGIA

Predict / Verify strategy performance

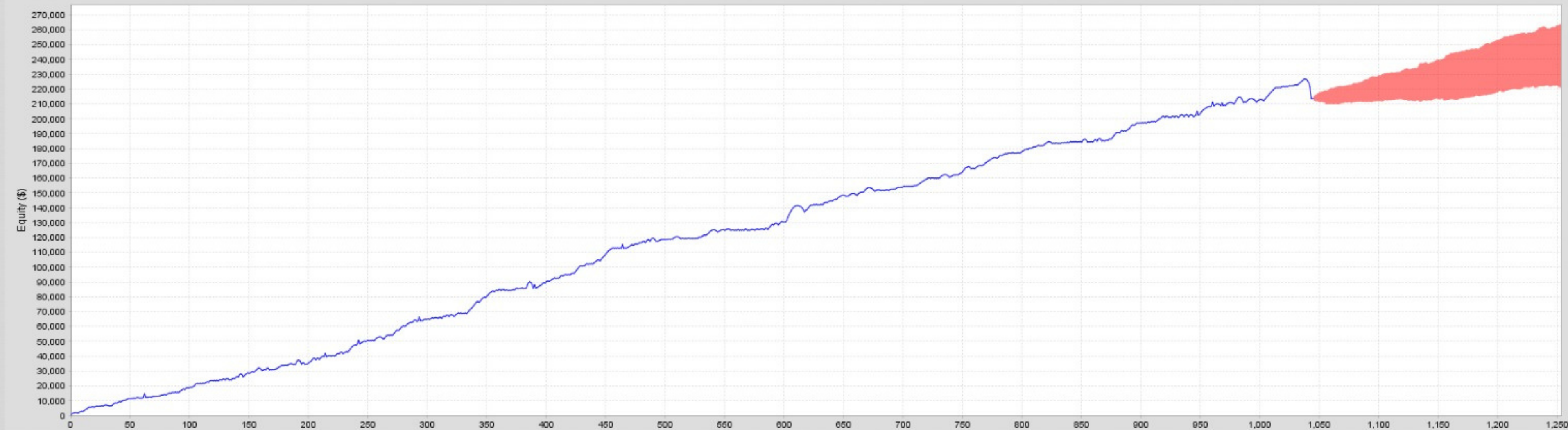


Type:

☒ Predict

☐ Verify - for date

30.07.2026 ▾



Prediction for the next 209 trades	Best	Worst
Net Profit	\$ 50162.9	\$ 6622.86

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 **6.622 nello scenario più conservativo** e **50.162 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.

62 STRATEGIE. PIÙ COPPIE VALUTARIE. UN UNICO PORTAFOGLIO.

Diversificazione quantitativa, automazione e controllo del rischio.

STRATEGIE DIVERSE. UN'UNICA ARCHITETTURA.

