

RECHERCHE QUANTITATIVE

Momentum Focus V1

Un modèle quantitatif développé par Jonathan Cenciarini.

Cette première version combine momentum, tendance et règles de gestion du risque. Elle présente une simulation historique sur un univers de 10 actions et ETF.

02.01.2020 - 31.12.2024 · PERFORMANCES SIMULÉES

Performance cumulée

+141,99 %

Gains et pertes latents inclus

Rendement annualisé

19,35 %

Sur la période étudiée

Baisse maximale observée

-16,44 %

Creux : 12.10.2022

Évolution du capital simulé

10 000 USD au départ · 24 199,01 USD au 31.12.2024



La valeur du portefeuille inclut les gains et pertes des positions encore ouvertes.

Baisses depuis les précédents sommets



La baisse maximale historique observée ne constitue pas un plafond de perte future.

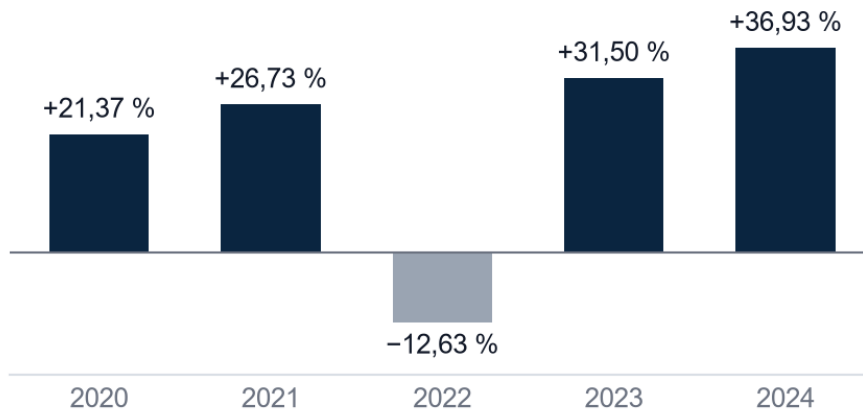
Résultats avant frais, commissions et écarts d'exécution (slippage).

COMPRENDRE LA PREMIÈRE VERSION

Lire les résultats avec méthode

Le périmètre étudié et la composition du portefeuille éclairent cette simulation.

Performances annuelles



2022, une année de baisse

-12,63 %

Les périodes de baisse font partie du parcours observé.

2020 commence au premier point publié du 02.01.2020.

Les principes du modèle

Momentum

Évaluer la dynamique des actifs à partir de leurs performances passées.

Tendance

Vérifier la cohérence de la tendance pour sélectionner les actifs éligibles.

Gestion du risque

Appliquer des règles de sortie lorsque les conditions prévues sont réunies.

La concentration au 31.12.2024

- **8 positions restent ouvertes** à la fin du backtest.
- **62,2 % du gain cumulé est latent** : il reste lié à ces positions ouvertes.
- **AVGO représente environ 46,9 % de l'exposition investie finale.**
- Le gain latent d'AVGO équivaut à **environ 48,5 % du gain total publié.**

Périmètre et limites de lecture

La V1 porte sur 10 actifs, avec des données historiques IB. Les résultats dépendent de cet univers, de la période et des hypothèses retenues. La diversification, la concentration et l'effet des coûts constituent des axes de recherche à approfondir.

Backtest historique, sans résultats d'investissement réels. Aucune garantie de performance. Les performances passées ou simulées ne préjugent pas des performances futures. Document informatif, ne constituant pas un conseil en investissement.