



BANKROOT

SI ON FAIT FAILLITE,
AU MOINS C'EST STYLÉ.

RAPPORT D'ACTIVITÉ

Notre équipe

INF5058 | Informatique pour la finance



Asset Manager

Mathis

- Gestion du portefeuille pour optimiser la performance.
- Prise de décisions stratégiques basées sur des analyses financières



Trader

Clément

- Exécution des ordres d'achat et de vente sur les marchés financiers.
- Réaction rapide aux fluctuations des marchés pour maximiser les profits.



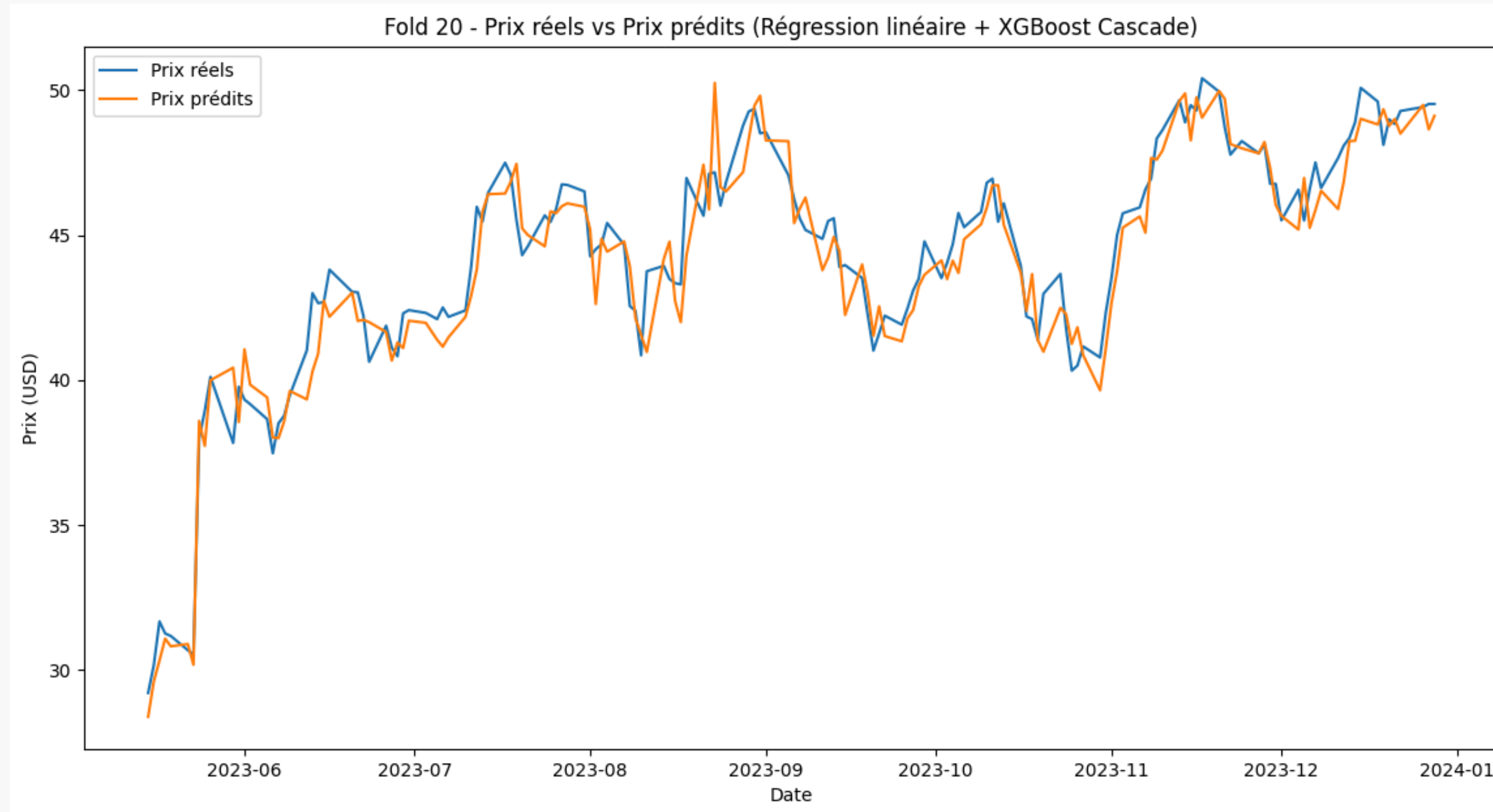
Risk Manager

Louis

- Analyse et évaluation des risques liés aux investissements.
- Mise en œuvre de stratégies pour limiter les pertes et protéger les actifs.

Recherche de stratégie :

Algorithme régression linéaire prédiction du prix d'une action J+1



**Fold 20 - R^2 Score: 0.9383,
Relative MAE: 1.8804%,
Relative RMSE: 2.3098%**

- Ne permet pas de faire du scalping
- Non adapté au trading Intraday

STRATÉGIES



Trading automatisé

Martingale : DCA - Croissance progressive du volume
Utilisation de 10% du capital de départ



Achat/Vente à découvert

Différents marchés : Crypto, Actions (Bancaire et énergie), Forex
Analyse multi échelle
Utilisation de la volatilité
Analyse technique / suivi de tendance

/1 Trading algorithmique

Rapport du Testeur de Stratégie

Expert: **Martingale**

Symbole: **EURUSD**


Période: **2023.01.01 - 2023.12.31**

Courtier: **XXXX**

Devise: **EUR**

Dépôt initial: **1 000.00**

Résultats

Qualité de l'Historique:  **100%**

Barres: **74 253**

Profit Total Net: **6 449.47**

Profit brut: **15 826.48**

Perte brut: **-9 377.01**

Facteur de profit: **1.69**

Facteur de récupération: **3.98**

Tiques: **14783 092**

Solde Drawdown Absolu: **0.00**

Solde Drawdown Maximal: **1 417.51 (19.82%)**

Solde Drawdown Relatif: **29.87% (799.06)**

Remboursement attendu: **49.23**

Ratio de Sharpe: **4.35**



/2 Dashboard, indicateurs techniques



RSI Divergence (surachats/surventes), période 14

Ajustement dynamique des positions aux
niveaux déterminés (entrées/sorties)



- Moyenne mobile exponentielle, période 12
- Bandes de bollinger, période 20

**BREAKING
NEWS**

- Correction crypto après 100k € du BTC
- Sortie du PDG de Stellantis



Le talent

Gestion des risques

1. Diversification du Portefeuille

Cryptomonnaies : Bitcoin, Solana, XRP

Actions : Total Energies, Crédit Agricole, Stellantis

3. Analyse des Risques par Classe d'Actif

Cryptomonnaies: Volatilité élevée, risque de marché

Actions: Impact des résultats trimestriels, cycles économiques.

4. Gestion des Liquidités

Maintien d'un fonds de réserve 40%

5. Apprentissage et Évaluation

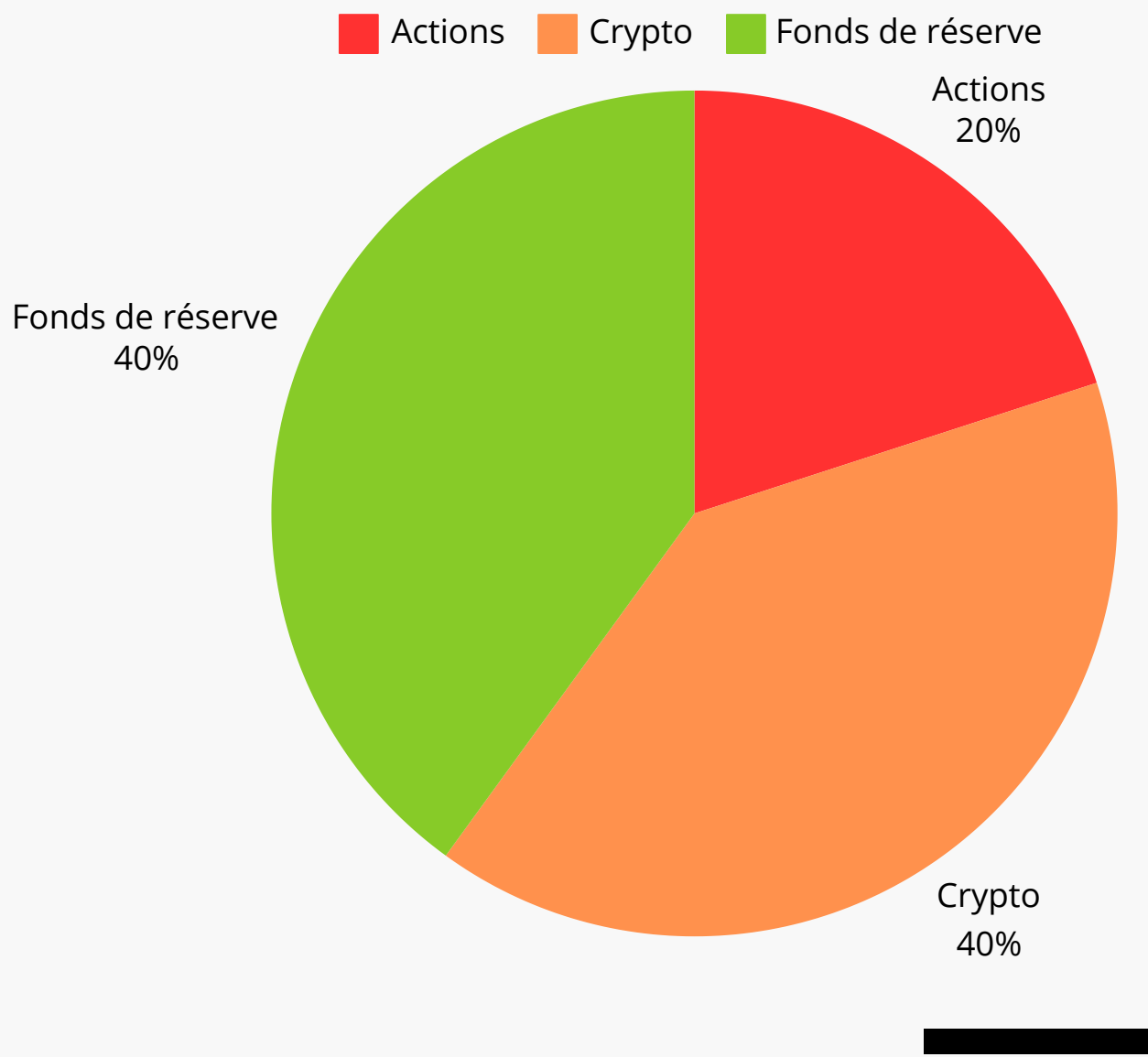
Révision des stratégies régulièrement en fonction des résultats et de l'évolution du marché.

Tenue d'un journal de trading pour analyser les erreurs passées.

6. Refus de prise de clients supplémentaires

Choix d'une collaboration avec Krash bank

2. Gestion des Allocations



Gestion des risques

Anticipation des Mouvements de Marchée

Stellantis CEO Carlos Tavares Has Abruptly Resigned

The company will be run by an executive committee headed by Stellantis chairman John Elkann before a new CEO is selected in the first half of 2025.

BY JACK FITZGERALD · PUBLISHED: DEC 2, 2024

Bitcoin Breaks Records: Is XRP Set to Skyrocket Next?



Marc Kramer · [Follow](#)

8 min read · 2 days ago

Collaboration commerciale

Accord avec la KrashBank

Accès par la KrashBank à nos transaction et nos placements financier en temps réel contre 2M€.

Payement échelonné:

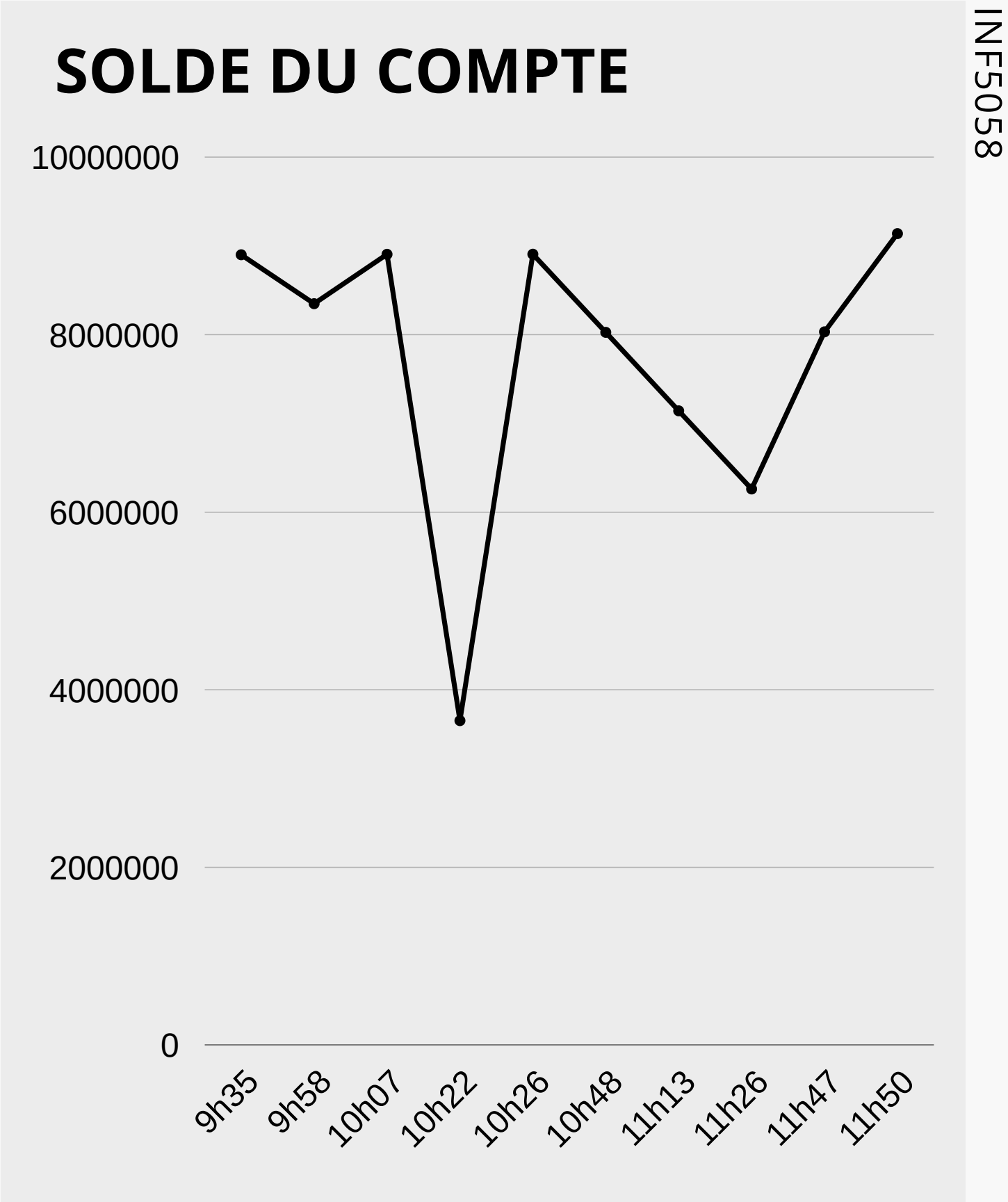
- 1er versement de 1M€ le 28/11/2024
- 2ème versement de 1M€ le 4/12/2024

Day 1

Date/heure d'achat	Ordre	Action	Prix action	Quantité	Prix TT
26/11/24 9h35	Achat	TTE	55,00	20000	1 100 000
26/11/24 9h58	Achat	SOLEUR	220,43	2500	551 075
26/11/24 10h07	Vente	SOLEUR	222,56	2500	556400
26/11/24 10h22	Achat	EURUSD	1,05	5 000 000	5253000
26/11/24 10h26	Vente	EURUSD	1,05	5 000 000	5254000
26/11/24 10h48	Vente à découvert	BTCEUR	88688,00	10	886880
26/11/24 11h13	Achat	SOLEUR	221,00	4 000	884000
26/11/24 11h26	Vente à découvert	BTCEUR	88331,00	10	883310
26/11/24 11h47	Rachat du découvert	BTCEUR	88028,00	20	1760560
26/11/24 11h50	Vente	TTE	55,32	20 000	1106400

Portefeuille à 12h

- 4000 SOLANA
- 9 138 355 € de liquidités



Day 2

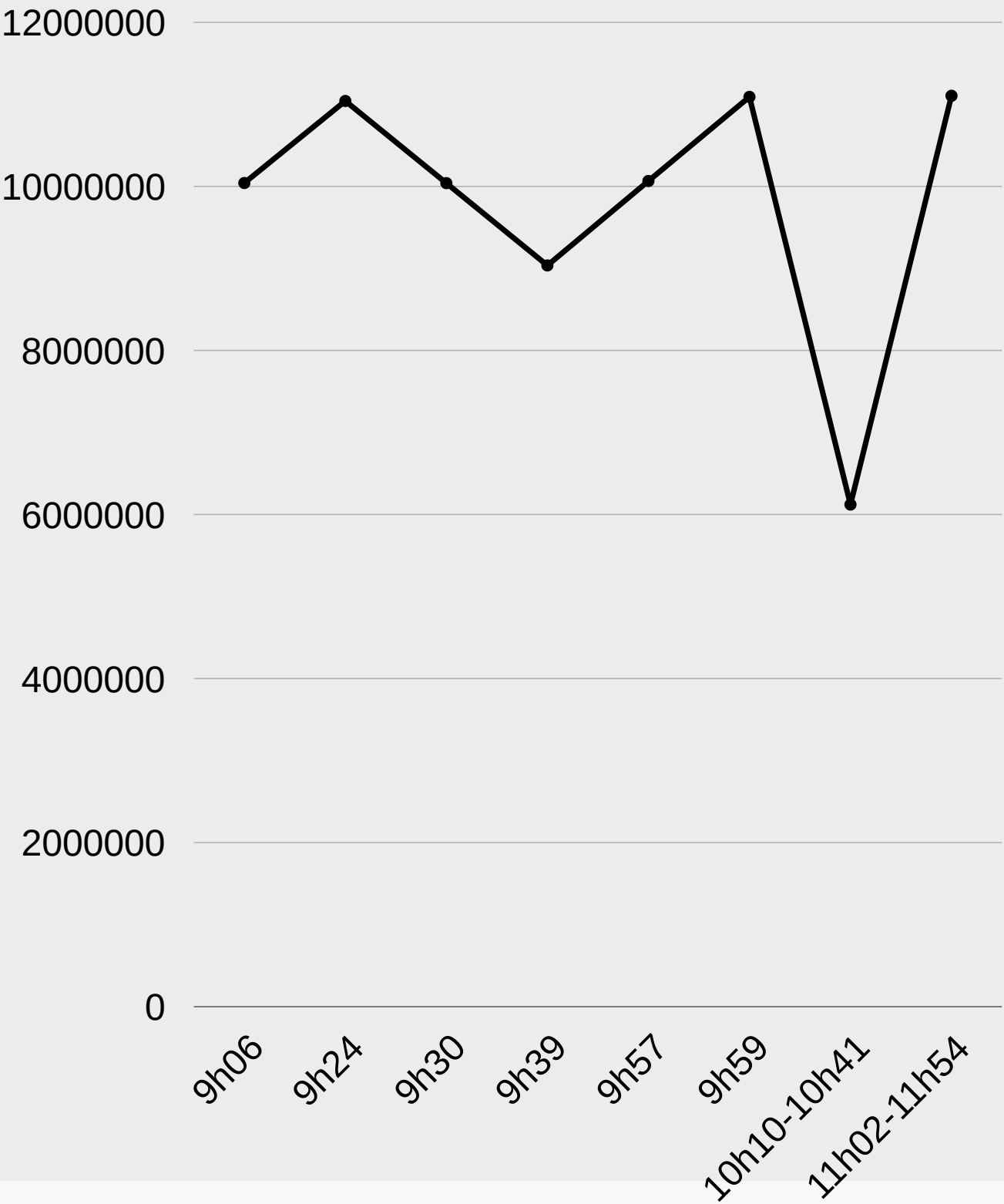
Ordre	Action	heure d'ordre	Prix initial	heure d'exécution	Prix execution	Quantité	Prix TT	avec Frais
Vente	SOLEUR	9h05	224,43	9h06	226,33	4 000	905 320	903 057
Virement reçu	CrashBank	9h23	1000000	9h24	1000000,00	1	1 000 000	1 000 000
Achat	ACA	9h29	12,48	9h30	12,49	80000	999200	1001698
Achat	ACA	9h38	12,51	9h39	12,51	80000	1000800	1003302
Vente	ACA	9h56	12,95	9h57	12,90	80000	1032000	1029420
Vente	ACA	9h57	12,9	9h59	12,85	80000	1028000	1025430
Vente à découvert	DOGEEUR	10h09	0,3834	10h10	0,3847	2599000	999783,32	Frais calculés dans l'autre tableau
Vente à découvert	DOGEEUR	10h15	0,3836	10h16	0,3834	2601000	997223,4	
Vente à découvert	DOGEEUR	10h24	0,3835	10h25	0,3830	2610900	999974,7	
Vente à découvert	DOGEEUR	10h40	0,3862	10h41	0,3860	2590000	999740	
Rachat de découvert	DOGEEUR	11h01	0,3807	10h02	0,3809	2599000	989959,1	
Rachat de découvert	DOGEEUR	11h08	0,3815	11h09	0,3811	2601000	991241,1	
Rachat de découvert	DOGEEUR	11h13	0,3823	11h14	0,3828	2610900	999452,52	
Rachat de découvert	DOGEEUR	11h28	0,3835	11h29	0,3833	2590000	992747	
Vente à découvert	DOGEEUR	11h42	0,3835	11h43	0,3838	2603000	999031,4	
Rachat de découvert	DOGEEUR	11h53	0,3797	11h54	0,378	2603000	983934	

Portefeuille à 12h

DOGE / EUR	frais	
Ventes à découvert	4995752,82	12489,3821
Rachat à découvert	4957333,72	12393,3343
Profit	13536,38365	24882,7164

- 11 104 798 € de liquidités
(+11.04 % d'évolution)

SOLDE DU COMPTE



INF5058

Day 3

Ordre	Action	e/heure d'o	Prix initial	re d'execu	Prix execution	Quantité	Prix TT	Frais
Vente à découvert	STLAP	9h06	11,75	9h07	11,7400	85 100	999 074	Frais calculé en annexe
Vente à découvert	SOLEUR	9h14	216,6	9h15	216,5200	4 600	995 992	
Rachat de découvert	SOLEUR	9h16	216,18	9h17	216,0600	4 600	993 876	
Vente à découvert	XRPEUR	9h25	2,23845	9h26	2,2383	418000	935 609	
Vente à découvert	SOLEUR	9h28	215,2	9h29	215,5700	4 600	991 622	
Vente à découvert	XRPEUR	9h36	2,1956	9h37	2,2035	450000	991 575	
Rachat de découvert	STLAP	9h41	11,5	9h42	11,4800	85 100	976 948	
Achat	SOLEUR	9h53	215,33	9h54	215,4700	4640	999 781	1002280,252
Vente	SOLEUR	10h16	215,61	10h17	215,9700	4640	1 002 101	999595,548
Vente à découvert	XRPEUR	11h31	2,1996	11h32	2,1956	455000	998 998	Frais calculé en annexe
Vente à découvert	SOLEUR	11h32	214,78	11h33	214,5100	4 660	999 617	
Rachat de découvert	XRPEUR	11h36	2,1654	11h37	2,1646	455000	984 893	
Rachat de découvert	XRPEUR	11h37	2,1646	11h38	2,1567	455000	981 299	
Rachat de découvert	SOLEUR	11h46	212,9	11h47	212,8300	4 660	991 788	
Rachat de découvert	SOLEUR	11h54	213,56	11h55	212,48	4 600	977 408	

SOL/EUR	frais	
Ventes à découvert	2 987 231	7468,0765
Rachat à découvert	2 963 072	7407,6795
Profit	9 283	14875,756

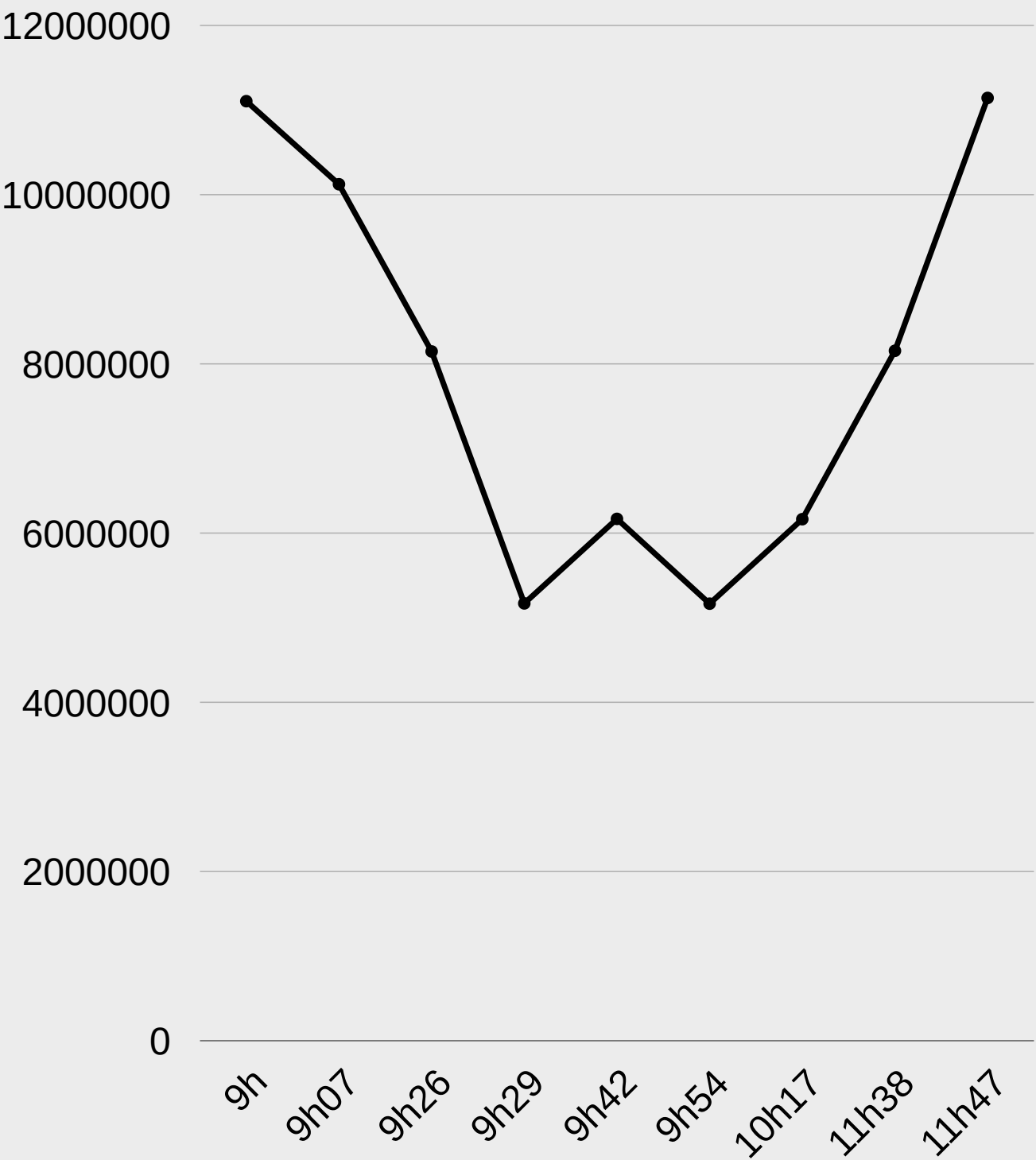
XRP/EUR	frais	
Ventes à découvert	1 990 573	4976,4325
Rachat à découvert	1 966 192	4915,47875
Profit	14 490	9891,91125

STLAP	frais	
Ventes à découvert	999 074	2497,685
Rachat à découvert	976 948	2442,37
Profit	17185,945	4940,055

Portefeuille à 12h

- 11 143 072 € de liquidités
(+11.43% d'évolution)
(+0.34% J-1)

SOLDE DU COMPTE



INF5058

Day 4

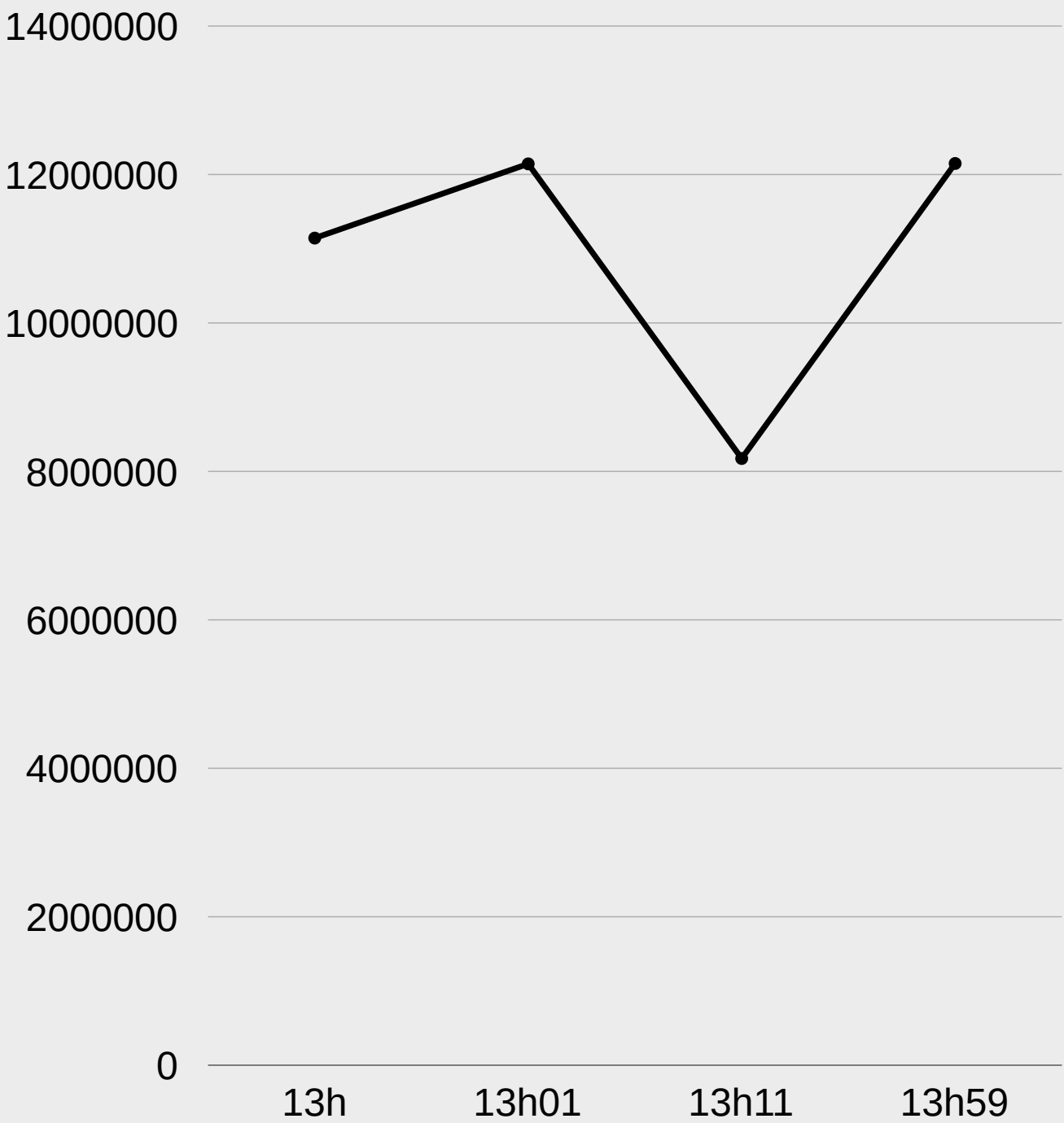
Ordre	Action	te/heure d'ori	Prix initial	heure d'executi	Prix execution	Quantité	Prix TT
Virement reçu	KrashBank	13h	1000000	13h	#####	1	1000000,00
Vente à découvert	SOLEUR	13h02	224,82	13h03	224,8000	4 440	998112,00
Vente à découvert	SOLEUR	13h08	224,05	13h09	223,8700	4 460	998460,20
Vente à découvert	SOLEUR	13h10	223,63	13h11	223,2000	4 480	999936,00
Rachat de découvert	SOLEUR	13h26	221,94	13h27	222,0000	4 480	994560,00
Rachat de découvert	SOLEUR	13h34	222,14	13h35	222,0100	4460	990164,60
Vente à découvert	SOLEUR	13h41	221,3000	13h42	221,3100	4 510	998108,10
Rachat de découvert	SOLEUR	13h56	221,68	13h57	221,7000	4510	999867,00
Rachat de découvert	SOLEUR	13h58	221,72	13h59	221,7900	4440	984747,60

Portefeuille à 14h

- 12 148 439 € de liquidités
(+9,02 % J-1)

SOL/EUR	frais	
Ventes à découvert	3 994 616	9986,54075
Rachat à découvert	3 969 339	9923,348
Profit	5 367	19909,8888

SOLDE DU COMPTE



INF5058

/03

Croissance globale du compte

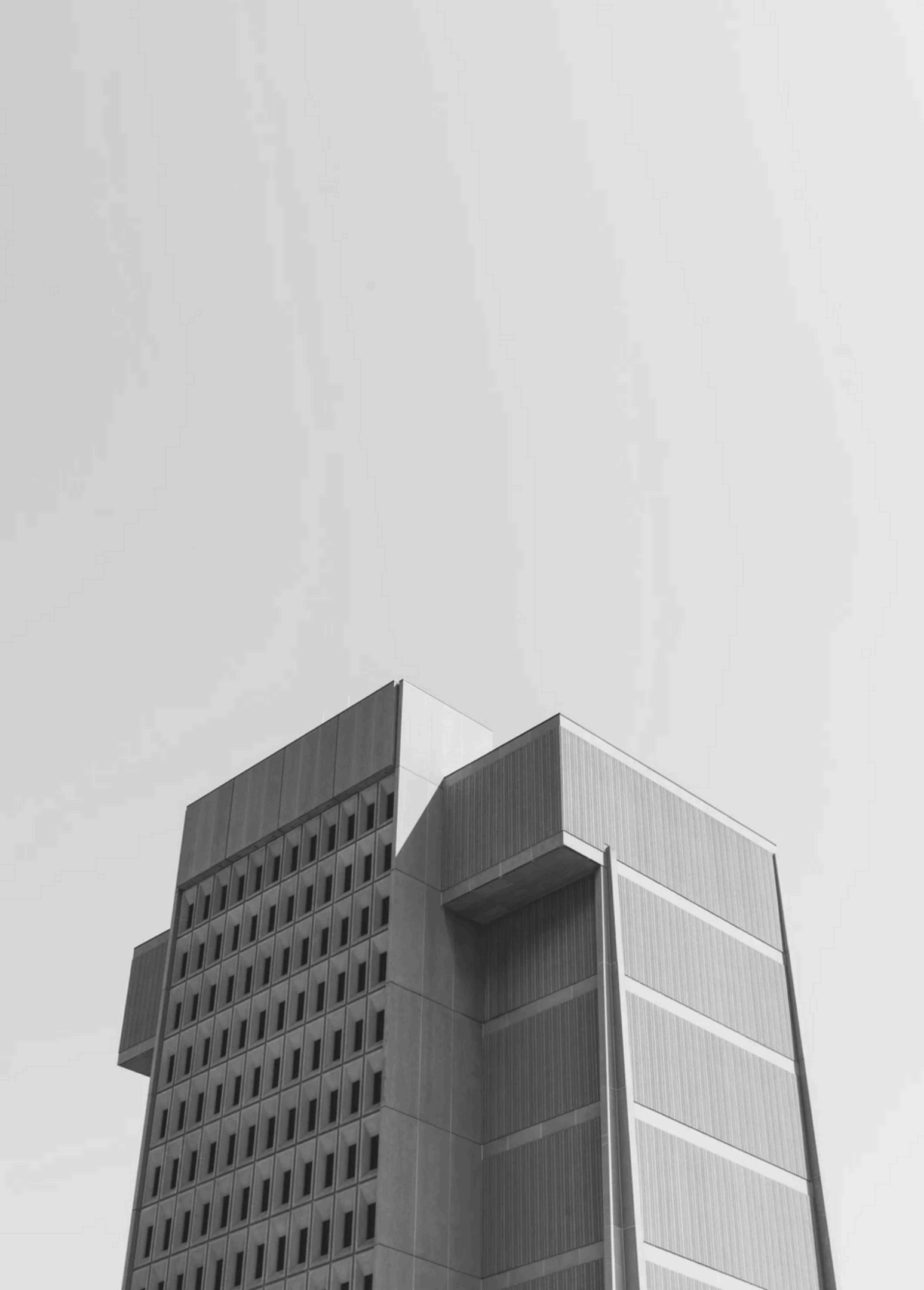
+ 21,48 %

—

INF5058

Solde final du compte

12 148 439 €



Merci !

