# Bandas de Bollinger y RSI · Apple

Retornos fechados del 2014-01-30 al 2018-12-31 · 1.239 observaciones

CONCLUSIÓN HISTÓRICO

## La diferencia con la referencia no se distingue de cero con estos datos

Intervalo del ratio de información (95,00 %): −0,63 a 1,14. Sin criterios declarados en esta evidencia.

RENTABILIDAD Y RIESGO

RENTABILIDAD

### Rentabilidad acumulada

56,98 % frente a 16,36 % de URTH.

RIESGO

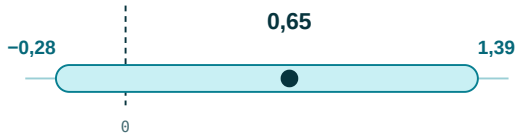
### Volatilidad anual

16,13 % frente a 15,20 % de URTH.

LAS CIFRAS PRINCIPALES

| MÉTRICA | ESTRATEGIA | REFERENCIA |
|---|---|---|
| **Rentabilidad anual compuesta** | **9,61 %** | 3,13 % |
| **Sharpe** | **0,65** | 0,28 |
| **Peor caída** | **−20,02 %** | −21,19 % |

**Intervalo del Sharpe de la estrategia**




La barra muestra el intervalo del 95,00 % para el Sharpe de la estrategia. Error estándar 0,42.

ALCANCE DEL RESULTADO

NIVEL DE EVIDENCIA **Histórico**

- **Alcance.** El informe resume las series de retornos incluidas en el paquete.
- **Firma.** Sin firma verificada. Procedencia confirmatoria sin verificar.
- El motor recalculó las métricas a partir de los retornos netos de la StrategyTrace verificada.
- **Anualización.** 252 periodos por año. Tipo libre de riesgo anual 0,00 %.
- **Incertidumbre.** El remuestreo usa la misma serie histórica.
- Monte Carlo tiene su propio hash. Solo afecta a los criterios si se prerregistró ese uso.

# Bandas de Bollinger y RSI · Apple · Métricas

Rentabilidad, riesgo, incertidumbre y configuración de la prueba.

## RENTABILIDAD Y RIESGO

| MÉTRICA | ESTRATEGIA | REFERENCIA |
|---|---|---|
| **Rentabilidad anual compuesta** | **9,61 %** | 3,13 % |
| **Rentabilidad anual aritmética** | **10,45 %** | 4,24 % |
| **Rentabilidad acumulada** | **56,98 %** | 16,36 % |
| **Volatilidad anual** | **16,13 %** | 15,20 % |
| **Sharpe** | **0,65** | 0,28 |
| **Sortino** | **1,05** | 0,38 |
| **Calmar** | **0,48** | 0,15 |
| **Peor caída** | **−20,02 %** | −21,19 % |
| **Periodos de máximo a mínimo** | **132** | 185 |
| **Periodos para recuperar el máximo** | **266** | 444 |
| **Periodos con retorno positivo** | **13,80 %** | 52,30 % |
| **Asimetría** | **3,43** | −0,78 |
| **Exceso de curtosis** | **73,70** | 7,17 |

## FRENTE A LA REFERENCIA

| MÉTRICA | ESTIMACIÓN |
|---|---|
| **Diferencia anual aritmética** | 6,21 % |
| **Tracking error** | 18,09 % |
| **Ratio de información** | 0,34 |
| **Beta** | 0,35 |
| **Correlación** | 0,33 |
| **Alfa de Jensen anual** | 8,94 % |

## INCERTIDUMBRE POR REMUESTREO

| MÉTRICA | INTERVALO |
|---|---|
| **Sharpe** | −0,28 a 1,39 |
| **Ratio de información** | −0,63 a 1,14 |
| **Error estándar del Sharpe** | 0,42 |
| **Remuestras válidas** | 1.000 |
| **Longitud del bloque** | 5 |
| **Nivel de confianza** | 95,00 % |

## CONFIGURACIÓN

| PARÁMETRO | VALOR |
|---|---|
| **Anualización** | 252 |
| **Tipo libre de riesgo anual** | 0,00 % |
| **Calendario** | NASDAQ |
| **Zona horaria** | UTC |
| **Índice** | Cronológico |

## VERIFICACIÓN DE LA EVIDENCIA

| COMPROBACIÓN | RESULTADO |
|---|---|
| **Esquema** | Verificado |
| **Hash de contenido** | Verificado |
| **Reconciliación** | Reconciliada |
| **Firma** | Sin firma verificada |
| **Procedencia confirmatoria** | Sin verificar |

## CRITERIOS EVALUADOS

Sin criterios declarados en esta evidencia.

## LÍMITES DE LA EVALUACIÓN

- **Sesgo de supervivencia.** No evaluado. Falta evidencia sobre la composición histórica del universo.
- **Look-ahead (información futura).** No evaluado. El informe no comprueba la disponibilidad de las señales.
- **Pruebas múltiples.** DSR y PBO no son evaluables con la evidencia aportada.
- **Costes y ejecución.** Se conciliaron los retornos brutos y netos con los costes registrados. No se evaluaron la sensibilidad a costes ni la ejecución real.
- **Uso de IA.** El motor calcula las métricas. El uso de IA en el desarrollo de la estrategia no se evaluó.
- **Asesoramiento.** Este informe no constituye asesoramiento de inversión.