IBS y dos EMA · AAPL

2011-01-04 a 2023-08-04 · 3.167 observaciones

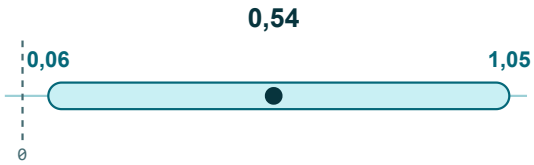
CONCLUSIÓN Histórico

La réplica histórica obtuvo +209.9% de rentabilidad neta, Sharpe 0.54 y drawdown máximo -37.6%. Al ejecutar las señales en la apertura siguiente, la rentabilidad fue +284.4%.

RENTABILIDAD Y RIESGO

MÉTRICA	ESTRATEGIA	REFERENCIA
Rentabilidad anual compuesta	9,42 %	—
Sharpe	0,54	—
Peor caída	−37,61 %	—

Intervalo del Sharpe



Bootstrap por bloques al 95,00 %. Error estándar 0,25.

CÓMO SE OBTUVO

Compra con IBS ≤0,25 y EMA8 <EMA24. Vende con IBS ≥0,75 y EMA8 >EMA24. El cuaderno usa el cierre para la señal y el mismo cierre para el precio de ejecución. Liquida cualquier posición en el cierre final.

2.000 USD iniciales, comisiones, deslizamiento y RF de 0 %, como hipótesis explícitas para reproducir el camino. El cuaderno carece de benchmark.

ALCANCE DE LA EVIDENCIA

NIVEL DE EVIDENCIA **Histórico** Evidencia de investigación sin firma

- El cierre definitivo alimenta la señal y fija el precio de esa misma orden. La réplica literal es exploratoria. Se calcula por separado la sensibilidad desplazando esas señales a la apertura siguiente, con la misma liquidación terminal.
- Trayectoria histórica única. Las cotizaciones ajustan splits y excluyen dividendos. Los costes reflejan las comisiones declaradas en el cuaderno, sin estimar deslizamiento ni horquilla.

IBS y dos EMA · AAPL

2011-01-04 a 2023-08-04 · 3.167 observaciones

RENTABILIDAD Y RIESGO

MÉTRICA	ESTRATEGIA	REFERENCIA
Rentabilidad anual compuesta	**9,42 %**	—
Rentabilidad anual aritmética	**11,14 %**	—
Rentabilidad acumulada	**209,87 %**	—
Volatilidad anual	**20,65 %**	—
Sharpe	**0,54**	—
Sortino	**0,78**	—
Calmar	**0,25**	—
Peor caída	**−37,61 %**	—
Periodos con retorno positivo	**18,38 %**	—
Periodos de máximo a mínimo	**208**	—
Periodos de recuperación	**662**	—
Asimetría	**−0,12**	—
Exceso de curtosis	**18,70**	—

COMPARACIÓN CON LA REFERENCIA

MÉTRICA	ESTIMACIÓN
Diferencia anual aritmética	—
Error de seguimiento	—
Ratio de información	—
Beta	—
Correlación	—
Alfa de Jensen anual	—

INCERTIDUMBRE Y VERIFICACIÓN

MÉTRICA	ESTIMACIÓN
IC del Sharpe	0,06 … 1,05
IC del ratio de información	—
t HAC del retorno activo	—
p bilateral HAC	—
Longitud de bloque	5
Remuestras válidas	1.000

CONFIGURACIÓN

MÉTRICA	ESTIMACIÓN
Referencia	—
Tipo libre de riesgo anual	0,00 %
Periodos por año	252
Calendario	NASDAQ