

Informe de ejemplo con datos sintéticos generados por ordenador: no es la cuenta ni la estrategia de nadie. Así se ve un informe completo.

RIGOR · AUDITORÍA DE BACKTEST



VEREDICTO

Clase C: hay una debilidad importante; no confiaríamos en este backtest sin resolverla.

DIMENSIONES

Significación estadística

• Supera

Número de configuraciones probadas

• Débil

Costes

• Débil

Fuera de muestra

• Débil

Calidad de datos y forma de operar

• Supera

Benchmark

• No aplica

RESUMEN EJECUTIVO

+173.7%

Retorno total

-8.2%

Drawdown máximo (solo cerradas)

-12.3%

Drawdown p95 a 1 año (solo cerradas)

1.79

Sharpe anualizado

QUÉ HACER AHORA

- 1 Pregunta al vendedor por qué tu cuenta real queda fuera de lo que el backtest hacía esperar.
- 2 Compara el spread y la comisión de tu bróker con los costes que aguanta el resultado: con un coste algo mayor que el de referencia, el margen se pierde.
- 3 Pregunta cuántas configuraciones se probaron antes de elegir esta y con qué periodo se eligió.

Cada cifra lleva su etiqueta: «Medido» si se calculó de tus archivos; «Declarado» si lo afirmas tú o el vendedor, sin verificar; «No medido» si faltó un dato para calcularla.

Informe de ejemplo con datos sintéticos generados por ordenador: no es la cuenta ni la estrategia de nadie. Así se ve un informe completo.

• RIGOR • AUDITORÍA DE BACKTEST

Veredicto C

Identificador sample

Generada 2026-09-24 00:00 UTC

versión del motor 0.1.0

semilla de las simulaciones 12345

VEREDICTO

Clase C: hay una debilidad importante; no confiaríamos en este backtest sin resolverla.

Como una sola prueba, el resultado es demasiado constante para explicarse solo por azar (Sharpe distinguible de cero). Con 120 intentos contados en los archivos, el Sharpe ajustado por esas pruebas no llega al umbral: si se probaron más configuraciones, el resultado puede venir de elegir la mejor. Las operaciones siguen en positivo con el coste de referencia, pero no con 3 veces ese coste. En el periodo apartado para comprobar (fuera de muestra) el resultado sigue positivo pero empeora. Sin banderas rojas en los datos. Benchmark declarado como no aplicable.

● Cuenta real: No coherente. Resultado de operar: -305.20 sobre 1,500.00 depositados. ● Medido [Ver la comparación con el backtest](#)

Cada cifra lleva su etiqueta: «Medido» si se calculó de tus archivos; «Declarado» si lo firmas tú o el vendedor, sin verificar; «No medido» si faltó un dato para calcularla.

Conciliación monetaria

Comparamos el capital inicial, los flujos conocidos y el resultado neto de operaciones cerradas con el saldo final. Una coincidencia no autentica el historial.

Cuadra dentro de la tolerancia

Las operaciones cerradas cuadran dentro de la tolerancia; esto no autentica el historial.

Bruto – costes detallados = neto de operaciones cerradas: $26,343.75 - 8,974.00 = 17,369.75$

Capital inicial + flujos conocidos + neto = saldo esperado: $10,000.00 + 0.00 + 17,369.75 = 27,369.75$

USD

Capital inicial	10,000.00	• Medido
Flujos después del inicio	0.00	• Medido
Resultado bruto cerrado	26,343.75	• Medido
Costes detallados	8,974.00	• Medido
Resultado neto cerrado	17,369.75	• Medido
Valor de posiciones abiertas	—	• No medido
Saldo final esperado	27,369.75	• Medido
Saldo final observado	27,369.75	• Medido
Diferencia (observado – esperado)	0.00	• Medido
Tolerancia	14.11	• Medido

Cobertura y límites

- **Curva:** reconstruida desde las operaciones de la plataforma
- **Operaciones cerradas:** 1282
- **Operaciones fuera del periodo de la curva:** 0
- **Depósitos y retiros:** enumerados por la plataforma
- **Posiciones abiertas:** sin valoración separada
- **Moneda:** USD

Resumen ejecutivo

+173.7%

Retorno total
cuánto cambió la
cuenta en todo el
historial

-8.2%

Drawdown máximo
(solo cerradas)
la peor caída desde
un máximo

-12.3%

Drawdown p95 a 1
año (solo
cerradas)
caída que se supera
en 1 de cada 20 años
simulados

1.79

Sharpe anualizado
rendimiento frente a
sus altibajos; más
alto, más estable

1.52

Profit factor

lo ganado por cada 1
perdido

1,282 · 55%

Operaciones · %
de aciertos

1.59

Coste extra que lo
lleva a cero (pb
por lado)

cuánto más puede
costar operar antes
de quedar en cero

+15,375.41

Sin las 5 mejores
operaciones

lo que queda del
resultado neto sin
esas 5; con todas:
+17,369.75

+140.0%

Sin los 5 mejores
periodos

rentabilidad total sin
esos 5; con todos:
+173.7%

Restando lo que pagaba el efectivo en dólares en esas mismas fechas (letras del Tesoro de EE. UU. a 3 meses, 2.57% al año en promedio), el Sharpe queda en 1.58. El Sharpe de arriba no resta ninguna tasa. Si la cuenta no es en dólares, lo justo sería restar la tasa de su propia moneda. Fuente: [FRED](#). • Medido

Qué significa para ti

Significación estadística

• Supera

Con tantos datos, un resultado así es difícil de obtener por pura suerte. Eso no dice nada de lo que pasará después: solo que el historial no es ruido.

Número de configuraciones probadas

• Débil

Parte del resultado puede venir de elegir la mejor de muchas configuraciones. Pregunta cuántas se probaron y pide el archivo de optimización.

Costes

• Débil

Con costes normales el resultado sigue positivo, pero con costes altos desaparece. Un spread o una comisión mayores que los supuestos lo borrarían.

Fuera de muestra

• Débil

Fuera de muestra el resultado sigue positivo, pero bastante peor que dentro. Es habitual en estrategias algo sobreajustadas.

Calidad de datos y forma de operar

• Supera

No encontramos saltos, huecos ni patrones de riesgo oculto en los archivos. Eso no descarta errores que los archivos no muestren.

Benchmark

• No aplica

Se declaró que no hay una referencia aplicable. La comparación con una alternativa pasiva queda fuera de este informe.

Qué hacer ahora

Si compraste o vas a comprar este robot o señal, esto es lo que conviene aclarar primero, según lo que encontró la auditoría.

1. Pregunta al vendedor por qué tu cuenta real queda fuera de lo que el backtest hacía esperar. [Ir al apartado →](#)
2. Compara el spread y la comisión de tu bróker con los costes que aguanta el resultado: con un coste algo mayor que el de referencia, el margen se pierde. [Ir al apartado →](#)
3. Pregunta cuántas configuraciones se probaron antes de elegir esta y con qué periodo se eligió. [Ir al apartado →](#)
4. Lleva al vendedor las preguntas de este informe. [Ir al apartado →](#)
5. Guarda este informe y su identificador; si el robot cambia, pide que se audite de nuevo.

Qué pide cada clase

La clase no mide cuánto se ganó, sino cuántas preguntas responden tus archivos. Una clase mejor no significa que la estrategia vaya a funcionar.

- A

La estadística y el número de intentos superan; costes, fuera de muestra y benchmark superan o no aplican; los datos no tienen banderas graves ni avisos.
- B

La estadística supera, el número de intentos supera o no se declaró y nada falla, pero falta medir o reforzar costes, fuera de muestra, benchmark, calidad de datos o el número de intentos.
- C

Una dimensión no supera, o la estadística o el número de intentos quedan en débil.

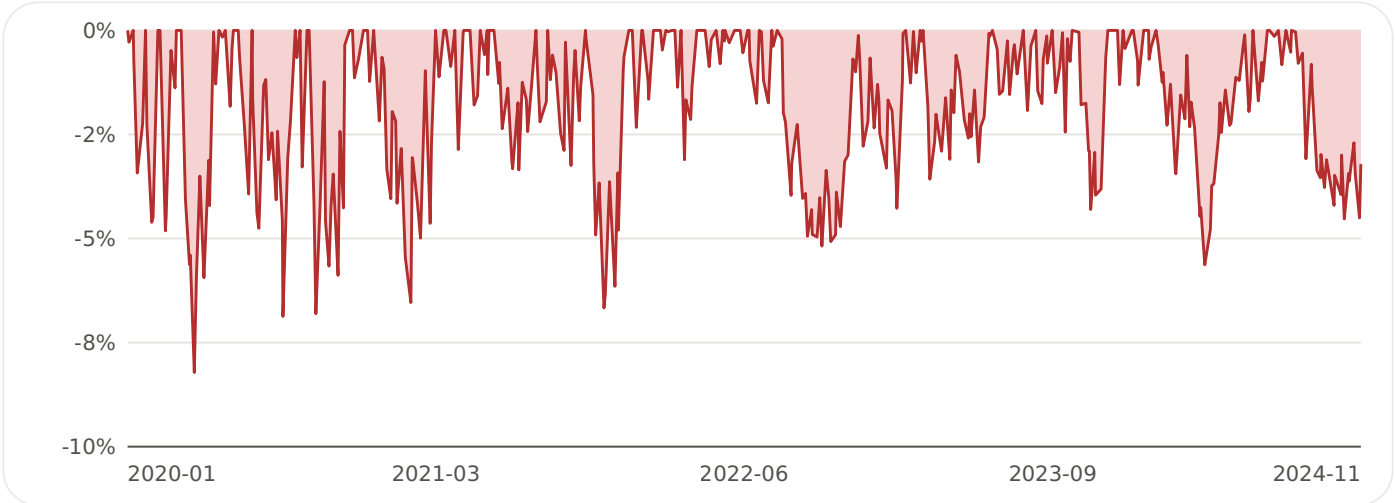
TU INFORME
- D

Los datos o la estadística no superan, o no superan dos dimensiones o más.

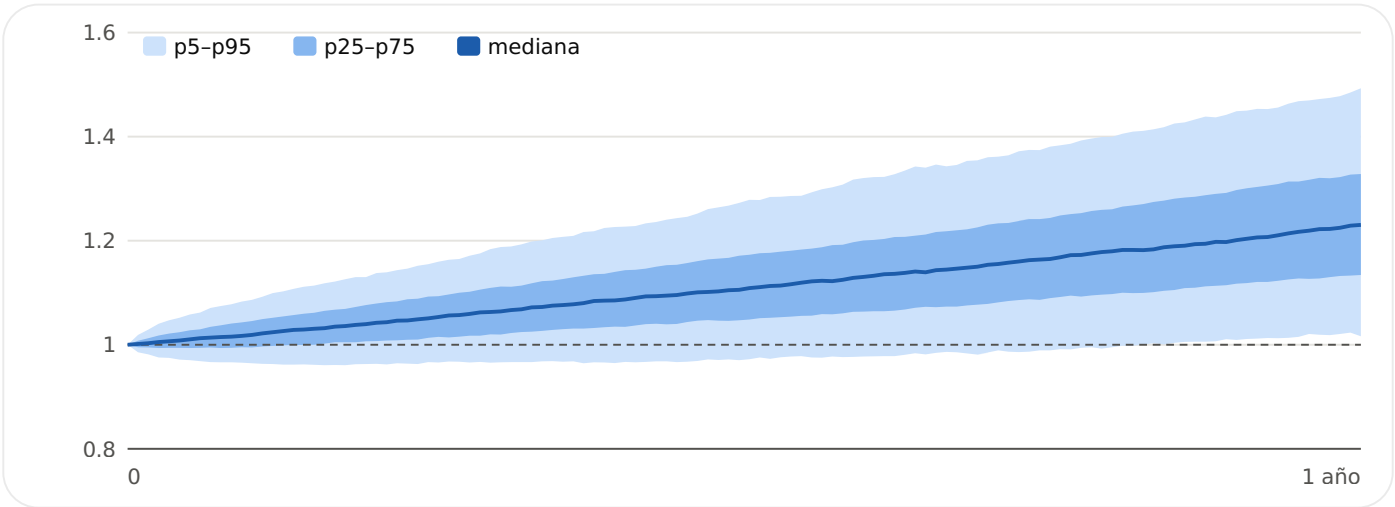
Gráficas



• Medido Curva de equity: 400 puntos, mín. 9,972, máx. 28k. Balance reconstruido con operaciones cerradas: no muestra el drawdown flotante.



Medido Drawdown (caída desde el máximo previo): máx. -8.2%. Balance reconstruido con operaciones cerradas: no muestra el drawdown flotante.



Medido Abanico de escenarios remuestreados. Remuestreado del historial aportado; no es un pronóstico ni describe resultados futuros.

AÑO	ENE	FEB	MAR	ABR	MAY	JUN	JUL	AGO	SEP	OCT	NOV	DIC	TOTAL
2020	+0.9%	+3.8%	+3.8%	+3.6%	+3.0%	+4.2%	-3.3%	+4.1%	-0.5%	0.0%	+8.1%	+5.7%	+38.3%
2021	-2.7%	-0.7%	+4.4%	+8.7%	+6.3%	+0.1%	-0.3%	+1.3%	+0.3%	+2.8%	-5.5%	+8.7%	+24.9%
2022	-0.9%	+8.4%	+3.2%	+6.9%	+4.8%	+2.4%	+2.5%	-2.2%	-2.7%	+1.0%	+3.9%	-2.2%	+27.4%
2023	+0.9%	+3.8%	-0.6%	+1.1%	-0.6%	+1.7%	+0.3%	+1.0%	+1.5%	-1.8%	+5.0%	+4.1%	+17.4%
2024	+2.9%	-0.9%	+1.0%	-1.1%	+2.0%	+0.3%	+4.5%	-0.2%	-2.7%	-0.5%	+0.8%		+6.0%

Medido Retornos mensuales.

Banderas rojas detectadas

✓ Sin banderas rojas en los archivos auditados.

Coherencia interna del archivo

Comprobaciones heurísticas de las filas del archivo; no comparan dos archivos independientes ni autentican quién creó el historial.

Versión del método: `forensics-1` · Familia del archivo: `mt5_tester` · Filas leídas: 2573 Medido

No apareció una señal calibrada en estas comprobaciones.

Una señal no demuestra falsificación; la ausencia de señales no prueba autenticidad.

Todas las comprobaciones y su estado

COMPROBACIÓN	ESTADO	CALIBRACIÓN
<code>FILE_TRACE</code>	Dato	Sin calibración aplicable
<code>TOTALS_VS_ROWS</code>	Dato	Calibrada para esta familia
<code>SUMMARY_IDENTITIES</code>	Dato	Calibrada para esta familia
<code>BALANCE_CHAIN</code>	Sin hallazgo	Calibrada para esta familia
<code>DEAL_SEQUENCE</code>	Sin hallazgo	Calibrada para esta familia
<code>TESTER_NUMBERING</code>	Sin hallazgo	Calibrada para esta familia
<code>TICKET_ORDER</code>	Dato	Sin calibración aplicable
<code>DUPLICATE_TICKET</code>	Sin hallazgo	Calibrada para esta familia
<code>TICKET_LINKS</code>	Dato	Sin calibración aplicable
<code>CROSS_COPIES</code>	Dato	Sin calibración aplicable
<code>SLTP_FILL</code>	Dato	Calibrada para esta familia
<code>PNL_SIGN</code>	Dato	Sin calibración aplicable
<code>PRICE_IMPLIED_PNL</code>	Dato	Sin calibración aplicable
<code>PRICE_PRECISION</code>	Sin hallazgo	Calibrada para esta familia
<code>TIME_SANITY</code>	Sin hallazgo	Calibrada para esta familia
<code>ROW_ORDER</code>	Sin hallazgo	Calibrada para esta familia
<code>MARKET_HOURS</code>	Sin hallazgo	Sin calibración aplicable
<code>HIDDEN_CONTENT</code>	Sin hallazgo	Calibrada para esta familia
<code>VOLUME_IN_OUT</code>	Sin hallazgo	Sin calibración aplicable
<code>STATEMENT_PERIOD</code>	Dato	Sin calibración aplicable
<code>TV_INVARIANTS</code>	Dato	Sin calibración aplicable
<code>NT_INVARIANTS</code>	Dato	Sin calibración aplicable
<code>MONTHLY_DIGITS</code>	Dato	Sin calibración aplicable

Plan para subir de clase

Lo que las reglas de la auditoría necesitarían ver en cada dimensión abierta, de lo más decisivo a lo menos. Una clase mejor significa que los archivos responden más preguntas, no que la estrategia vaya a funcionar.

01 Mide cuántas configuraciones se probaron

• Débil

DSR 0.905 con 120 intentos; supera con 0.95 o más, y por debajo de 0.5 no supera. Con 16384 o más configuraciones probadas cae por debajo de 0.5.

- El número de intentos ya sale de tus archivos; la matriz de variantes (el resultado de cada configuración a lo largo del tiempo) añadiría el PBO.
- Menos parámetros y rangos más cortos reducen el número de intentos.
- Valida la configuración elegida en un tramo que no se usó al optimizar.

Si esta dimensión pasara y las demás quedaran igual, la clase sería **B**.

02 Comprueba los costes reales

• Débil

El neto llega a cero con 1.59 pb por lado de coste extra. Para pasar esta dimensión tiene que seguir por encima de cero a 3x la referencia (3.00 pb por lado).

- Compara ese margen con el spread y el deslizamiento reales de tu bróker: en EURUSD a 1.10, 1 pb por lado son unos 1.1 pips.
- Declara el coste real por lado al subir: se suma a lo que el informe ya detalla.
- Menos operaciones o un recorrido mayor por operación hacen que el coste pese menos.

03 Añade un tramo fuera de muestra

• Débil

Sharpe fuera de muestra 0.54; hace falta 0.5 o más (cumple). Sharpe dentro de muestra menos el de fuera: 1.35; se acepta hasta 1.0 (no cumple).

- Una caída fuerte fuera de muestra aparece a menudo cuando se ajustaron demasiados parámetros: menos parámetros y una nueva validación en datos no vistos.

Backtest frente a cuenta real

Si las operaciones de la cuenta real salieran del mismo backtest, ¿qué tan raro sería su resultado? Tomamos al azar operaciones del backtest, tantas como tiene la cuenta real, 5,000 veces, y ubicamos la cuenta real entre esas historias.

No coherente

La cuenta real no se comporta como el backtest: su resultado neto o su peor caída quedan peor que en el 99 % de las historias del backtest.

	CUENTA REAL, A TAMAÑO DEL BACKTEST	RANGO ESPERADO (99 %)	BACKTEST
Operaciones	180		1,282
Periodo	2024-09-09 – 2025-06-20		2020-01-02 – 2024-11-29
Operaciones al mes	19.3		21.8
Aciertos	47%	49% ... 61%	55%
Resultado neto	-1,526.00	-348.92 ... 5,177.01	17,369.75
Peor caída	1,862.50	629.30 ... 2,186.22	1,528.76
Ganancia media	102.62		103.36
Pérdida media	-105.69		-94.81

1%

Historias del backtest con un resultado neto igual o peor

Medido

10%

Historias del backtest con una caída igual o más profunda

Medido

La cuenta real opera 0.20 veces el tamaño del backtest: cada operación real se ajustó al tamaño mediano del backtest antes de comparar.

Parte de la cuenta real cae dentro del periodo del backtest: esas fechas pudieron usarse para ajustar el backtest, así que la comparación es menos exigente.

Operaciones del backtest tomadas al azar con reemplazo, tantas como tiene la cuenta real; los costes detallados por operación se restan en ambos lados. No conserva las rachas.

Mismas fechas, operación por operación

Del 2024-09-09 al 2024-11-29 los dos archivos cubren los mismos días. Buscamos cada operación real en el backtest: mismo lado, mismo símbolo y entrada a menos de 60 minutos.

Operaciones reales encontradas en el backtest	55 de 59 (93%)	• Medido
Operaciones del backtest que la cuenta real no hizo	4 de 59 (7%)	• Medido
Diferencia mediana de precio al entrar	0.7 pb	• Medido
Diferencia mediana de precio al salir	1.0 pb	• Medido
Diferencia de resultado en las emparejadas	-82.60 (-1.50 por operación)	• Medido

pb = puntos básicos (0,01 % del precio); positivo es peor para la cuenta. La diferencia de resultado está al tamaño del backtest; negativa es lo que la cuenta real hizo por debajo del backtest en las mismas operaciones.

El dinero real de la cuenta

El porcentaje de ganancia que muestran los sitios de historiales quita los depósitos y los retiros. Aquí lo ponemos junto al dinero que la cuenta ganó o perdió operando, los depósitos hechos en plena pérdida y las posiciones que seguían abiertas al imprimir el historial.

Revisión del historial que subiste como cuenta real. Sus banderas se muestran aquí y no cambian la clase del backtest.

• Aviso

Depósitos en plena pérdida

1 depósito llegó cuando la cuenta estaba al menos un 20% por debajo de su máximo

-30%

Ganancia en %, como la muestran los sitios de historiales.

• Medido

-305.20

Resultado de operar, en dinero, sobre 1,500.00 depositados.

• Medido

4%

Pérdida abierta sobre el balance al imprimir el historial.

• Declarado

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Depósitos	2	• Medido	
Dinero depositado	1,500.00	• Medido	
Retiros	1	• Medido	
Dinero retirado	300.00	• Medido	

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Resultado de operar, en dinero	-305.20	• Medido	Operaciones cerradas después de comisiones y swap, en la divisa de la cuenta
Ganancia en %	-30.03%	• Medido	Ponderada en el tiempo: se quitan depósitos y retiros, como calculan la ganancia los sitios de historiales
Resultado sobre lo depositado	-20.35%	• Medido	Resultado de operar / dinero depositado
Parte retirada de lo depositado	20.00%	• Medido	Retirado / depositado
Depósitos después de empezar a operar	1	• Medido	
Depósitos en plena pérdida	1	• Medido	
Resultado flotante al imprimir	-35.00	• Declarado	Resumen de la propia plataforma al momento del historial
Flotante sobre el balance	-3.91%	• Declarado	Resultado flotante / balance

Depósitos después de empezar a operar, de mayor a menor

FECHA	IMPORTE	BALANCE ANTES	DRAWDOWN ENTONCES
2025-02-18	500.00	708.80	-32.03%

Leído del archivo tal como lo subiste; nada se comprobó con el bróker.

Con qué datos se hizo la prueba

El encabezado del informe dice cómo se simularon los precios, qué parte del historial tuvo el probador y qué fechas se probaron. Conviene verificarlo, así que aquí lo comparamos con sus propias operaciones.

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Modelado de precios	—	No medido	El informe no indica un modo de modelado que reconozcamos
Calidad de datos	—	No medido	El informe no imprime la calidad de datos (n/a)
Prueba desde	2020-01-02	Declarado	Tal como lo imprime el encabezado del informe
Prueba hasta	2024-11-29	Declarado	Tal como lo imprime el encabezado del informe
Operaciones fuera de esas fechas	0	Medido	Operaciones que abren o cierran fuera de las fechas que el encabezado dice que se probaron

El modelado, la calidad de datos y las fechas declaradas no levantan ninguna bandera.

Leído del encabezado tal como lo subiste: si alguien lo editó, solo lo detectamos cuando no cuadra consigo mismo o con las operaciones.

Pruebas de estrés: sin los mejores resultados

Quitamos los mejores periodos y operaciones de lo que subiste y medimos lo que queda. Si el total cae a cero o menos, depende de unos pocos eventos que pueden no repetirse. No es una previsión.

1 de 8 escenarios quedan en cero o por debajo.

Sobre la curva (retorno total compuesto)

ESCENARIO	QUEDA	CAMBIO	¿SIGUE SOBRE CERO?
Original Medido	173.7%		
Sin el mejor 1 % de periodos (13)	100.4%	-73.3%	Sí
Sin los 5 mejores periodos	140.0%	-33.7%	Sí

ESCENARIO	QUEDA	CAMBIO	¿SIGUE SOBRE CERO?
Sin los 10 mejores periodos	113.8%	-59.9%	• Sí
Sin el mejor mes (2021-12)	151.7%	-22.0%	• Sí

Sobre las operaciones cerradas (resultado neto tras comisiones y swap)

ESCENARIO	QUEDA	CAMBIO	¿SIGUE SOBRE CERO?
Original • Medido	17,369.75		
Sin la mejor operación	16,897.65	-472.10	• Sí
Sin las 5 mejores operaciones	15,375.41	-1,994.34	• Sí
Sin el mejor 10 % de operaciones (129)	-13,338.41	-30,708.16	• No
Sin el mejor mes (2022-02)	15,784.89	-1,584.86	• Sí

Las 5 mejores operaciones suman este múltiplo del resultado neto: 0.11x • Medido

Cómo se vivió este historial

Un total y una caída máxima no dicen cómo se vivió el historial: cuánto tiempo pasó sin un nuevo máximo, cuánto tardó en volver la peor caída, y cómo fueron el peor día y el peor mes. Son las cifras que hacen que alguien apague un sistema.

184 días Tiempo más largo sin un nuevo máximo (3 ago 2022 a 3 feb 2023) • Medido	19 días Peor caída: días del máximo (19 mar 2020) al mínimo (7 abr 2020) • Medido	36 días Días desde ese mínimo hasta volver al máximo • Medido
-3.7% Peor día (24 feb 2020) • Medido	-5.5% Peor mes (nov 2021) • Medido	68% Meses en positivo (40 de 59); racha más larga de meses en negativo: 3 • Medido

2.77

Ratio Calmar sobre 4.9 años:
retorno anual compuesto
dividido entre la peor caída

• Medido

-1.5%

Rentabilidad media por día en el
peor 5 % de los días (65 de
1282)

• Medido

-3.8%

Rentabilidad media por mes en el
peor 5 % de los meses (3 de 59)

• Medido

Las peores caídas • Medido

CAÍDA	DEL MÁXIMO AL MÍNIMO	DE VUELTA AL MÁXIMO	DURACIÓN TOTAL
-8.2%	19 mar 2020 → 7 abr 2020 (19 días)	13 may 2020 (36 días)	55 días
-6.9%	30 jun 2020 → 14 ago 2020 (45 días)	27 ago 2020 (13 días)	58 días
-6.8%	21 sep 2020 → 1 oct 2020 (10 días)	13 nov 2020 (43 días)	53 días
-6.7%	28 oct 2021 → 24 nov 2021 (27 días)	24 dic 2021 (30 días)	57 días
-6.5%	24 dic 2020 → 16 feb 2021 (54 días)	23 mar 2021 (35 días)	89 días

Cada caída va del último punto en un máximo a su punto más bajo y termina en la primera fecha de vuelta en ese máximo. Una que no vuelve antes de la última fecha del archivo sigue abierta.

La curva se reconstruye con operaciones cerradas: las pérdidas abiertas no se ven, así que las caídas reales duraron y midieron al menos esto.

Días naturales de la curva de equity aportada; meses con el último punto de cada mes.

Cuándo gana y cuándo pierde

Tus operaciones agrupadas por el día y la hora de entrada. Si casi todo el resultado sale de un solo día o de una sola franja, un cambio de horario del servidor, de festivos o de noticias puede borrarlo.

36%

El 36% del resultado neto sale
de los jueves.

• Medido

33%

El 33% del resultado neto sale
de la franja 16:00–19:59.

• Medido

DÍA DE ENTRADA	OPERACIONES		RESULTADO NETO	ACIERTOS
Lunes	256		+3,097.50	58%
Martes	256		+2,908.32	51%
Miércoles	256		+4,239.72	58%
Jueves	257		+6,331.45	56%
Viernes	257		+792.76	50%

HORA DE ENTRADA	OPERACIONES		RESULTADO NETO	ACIERTOS
00:00–03:59	206		+4,137.98	56%
04:00–07:59	169		+2,372.34	52%
08:00–11:59	351		+3,055.70	56%
12:00–15:59	165		+2,045.94	53%
16:00–19:59	391		+5,757.79	54%

Horas de entrada tal como las da el archivo (hora de la plataforma o del servidor); resultado neto después de los costes que el archivo detalla por operación.

¿Sigue funcionando en el periodo reciente?

Un historial largo puede verse bien en total aunque su último tramo ya no sume. Partimos el tiempo del historial en tres tramos iguales y comparamos el último con los dos anteriores, operación por operación.

• Se mantiene

El último tercio del historial no muestra una caída a pérdidas que el azar no explique.

+14.94

Media por operación antes del 11 abr 2023

• Medido

+10.77

Media por operación desde el 11 abr 2023

• Medido

+4,609.62

Resultado neto desde el 11 abr 2023 (428 operaciones) • Medido

-0.6

Distancia entre ambas medias, en errores estándar (-2 o menos: una caída que el azar difícilmente explica) • Medido

AÑO DE CIERRE	OPERACIONES		RESULTADO NETO	ACIERTOS
2020	261		+3,827.60	56%
2021	261		+3,438.56	54%
2022	260		+4,734.67	57%
2023	260		+3,828.60	56%
2024	240		+1,540.32	50%

Operaciones cerradas por fecha de cierre; resultado neto tras los costes que detalla el archivo.

¿Cambió su rentabilidad media en algún momento?

Buscamos el momento en que la rentabilidad media de la curva más cambió y medimos si ese cambio es mayor que el vaivén normal de sus retornos (prueba CUSUM, que tiene en cuenta que un retorno puede influir en el siguiente). No cambia la clase.

• Sin cambio claro

No hay un cambio claro en la rentabilidad media a lo largo del historial ($p = 0.154$): las diferencias entre tramos caben en el vaivén normal de sus retornos. No prueba que no haya cambiado: un cambio pequeño puede pasar sin verse. • Medido

CUSUM de los retornos en orden de tiempo (Ploberger y Krämer); varianza de largo plazo prudente; valor p del puente browniano.

¿Cómo le fue en las crisis conocidas?

Rentabilidad de la curva, con sus saldos de fin de mes, en cada caída de mercado de fecha pública que cubre completa (del máximo al mínimo del mercado). Un mes sin operaciones cuenta como plano. Las fechas son fijas: no se ajustan al archivo.

• Medido

CRISIS	ESTRATEGIA	MERCADO EN ESAS FECHAS
Caída por el covid 2020-02 – 2020-03	+7.8%	S&P 500 -19.9% Nasdaq Composite -15.8%
Inflación y tipos, 2022 2022-01 – 2022-09	+24.2%	S&P 500 -24.8% Nasdaq Composite -32.4%
Invierno cripto 2022 2021-11 – 2022-12	+30.9%	Bitcoin (Coinbase) -73.0%

Mercado: variación entre el cierre del mes previo a la ventana y el de su último mes, una cifra histórica fija comprobada el 2026-09-25 con los niveles del índice en FRED ([S&P 500](#), [Nasdaq Composite](#), [Bitcoin \(Coinbase\)](#)); no se lee ni se muestra ningún otro dato de esos índices. Son acciones de EE. UU. y bitcoin: si la estrategia opera otro mercado (divisas, materias primas, otro país), tómelos solo como contexto de lo que vivía el mercado, no como su punto de comparación.

Peores 12 meses seguidos: +4.2%; mejores: +41.7%. Terminaron en positivo el 100% de los periodos de 12 meses.

• Medido

¿Cómo le fue con el mercado tranquilo y con el mercado agitado?

Cada rentabilidad del archivo se asigna según el VIX (cuánto espera el mercado de opciones que se mueva el S&P 500 el mes siguiente) al cierre del día de mercado anterior a que empiece: mercado tranquilo por debajo de 20, agitado desde 20. Desde 1990 el VIX cerró en 20 o más aproximadamente un día de cada tres. Periodo: del 2020-01-01 al 2024-11-29.

• Medido

	MERCADO TRANQUILO (VIX < 20)	MERCADO AGITADO (VIX ≥ 20)
Parte del tiempo	51%	49%
Rentabilidades contadas	661	621
Rentabilidad por mes (compuesta)	1.66%	1.79%
Sharpe (rentabilidad por unidad de riesgo)	1.85	1.74

La diferencia de rentabilidad media entre las dos columnas (0.19 errores estándar) no basta para decir que se comporta distinto según el mercado. • Medido

VIX: datos públicos de [FRED](#) (serie VIXCLS, de CBOE) leídos al generar el informe. Mide acciones de EE. UU.: si la estrategia opera otro mercado, tómalo como termómetro general del miedo en los mercados. No cambia la clase.

¿Cuánto valió la cuenta en tu moneda y después de la inflación?

Los saldos de la curva, en dólares, convertidos al tipo de cambio de cada día (cotización del mediodía en Nueva York de la Reserva Federal), del 2020-01-01 al 2024-11-29. Si vives con otra moneda, esto es lo que valió la cuenta en ella. La diferencia con la fila en dólares viene del tipo de cambio, no de la estrategia: cuando el dólar sube frente a tu moneda, el resultado en ella sube, y cuando baja, baja. Medido

MONEDA	RENTABILIDAD TOTAL	AL AÑO	PEOR CAÍDA
Dólares (la cuenta)	+173.7%	+22.7%	-8.2%
Dólares después de la inflación de EE. UU.	+123.8%	+17.8%	-7.6%
Pesos mexicanos (MXN)	+194.8%	+24.6%	-15.5%
Pesos mexicanos (MXN), después de su inflación	+128.3%	+18.3%	-19.1%
Reales (BRL)	+308.3%	+33.1%	-15.8%
Reales (BRL), después de su inflación	+208.2%	+25.7%	-16.1%
Euros (EUR)	+191.3%	+24.3%	-12.3%
Euros (EUR), después de su inflación	+140.2%	+19.5%	-12.6%
Libras esterlinas (GBP)	+186.0%	+23.8%	-13.3%
Libras esterlinas (GBP), después de su inflación	+129.0%	+18.4%	-15.7%
Yenes (JPY)	+278.8%	+31.1%	-13.1%
Yenes (JPY), después de su inflación	+246.1%	+28.7%	-13.9%
Dólares canadienses (CAD)	+195.9%	+24.7%	-11.3%
Dólares canadienses (CAD), después de su inflación	+150.2%	+20.5%	-10.8%
Francos suizos (CHF)	+149.5%	+20.4%	-11.0%
Francos suizos (CHF), después de su inflación	+135.2%	+19.0%	-11.0%

La inflación de EE. UU. en esas fechas fue de +22.3% en total (+4.2% al año). Medido

Las filas «después de su inflación» dividen entre el índice oficial de precios al consumidor de cada país de cada mes, o el del último mes publicado; una moneda sin ese índice al día muestra solo su fila antes de inflación. El rendimiento al año se muestra con al menos un año de historial. Tipos de cambio y precios de EE. UU. de [FRED](#), leídos al generar el informe. No cambia la clase. Precios al consumidor: [peso mexicano](#), Fuente: INEGI, Índice Nacional de Precios al Consumidor (INPC), usado aquí para descontar la inflación de los saldos; [real](#), Banco Central do Brasil (IPCA del IBGE); [euro](#), Eurostat (vía

Cómo se comporta al perder

Lo que te diría un diario de trading: si las pérdidas se aguantan más que las ganancias, si se vuelve a entrar deprisa tras perder y cómo salen las operaciones tras una racha de pérdidas. No cambia la clase: son preguntas para hacer.

Sin patrones

Nada destaca en cómo opera después de perder.

1.1x

Lo que dura una perdedora frente a una ganadora (mediana: 4.0 h frente a 3.7 h)

Medido

53%

Aciertos tras 2 pérdidas seguidas (261 operaciones; en todo el historial: 55%)

Medido

Operaciones cerradas por hora de entrada y de cierre; resultado neto tras los costes que detalla el archivo.

¿Funciona en cada instrumento?

Cuando un robot o una señal opera varios mercados, el total puede venir de uno solo mientras los demás pierden. No cambia la clase: son preguntas para hacer.

Repartido

Ningún instrumento carga él solo con el resultado.

58%

Parte del resultado neto que viene de AUDUSD

Medido

Instrumento	Operaciones		Resultado neto	Aciertos
AUDUSD	648		+10,057.16	55%
EURUSD	634		+7,312.59	54%

Operaciones cerradas por el instrumento que indica el archivo; resultado neto tras los costes que detalla el archivo.

Estadísticas de las operaciones

Con el mismo porcentaje de perdedoras y en orden al azar, lo normal es una racha máxima de 8 perdedoras seguidas, y 1 de cada 20 historiales llega a 11. Este historial tuvo 7.

Medido

¿Cuánto de esto podría ser azar?

Con 1,282 operaciones, cada cifra tiene un margen. Rango al 95 %: los valores de fondo compatibles con estas operaciones, si cada una es independiente de las demás y el sistema no cambió. No es una predicción.

51.95% – 57.39%

Aciertos

Medido

6.75 – 20.35

Esperanza por operación

Medido

1.32 – 1.76

Factor de beneficio

Medido

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Operaciones	1,282	Medido	
Aciertos	54.68%	Medido	Parte de las operaciones con resultado neto positivo, después de los costes que detalla el archivo
Beneficio bruto de las ganadoras	77,425.10	Medido	
Pérdida bruta de las perdedoras	-51,081.35	Medido	
Comisiones y swap	8,974.00	Medido	Comisión y swap del informe, como coste positivo
Resultado neto	17,369.75	Medido	Resultado bruto menos los costes del informe
Esperanza por operación	13.55	Medido	Resultado neto medio por operación, en la divisa de la cuenta
Aciertos antes de comisiones	56.16%	Medido	Proporción de operaciones con resultado > 0
Factor de beneficio	1.52	Medido	Beneficio bruto / pérdida bruta, antes de comisiones y swap; una plataforma que los cuenta dentro de cada operación puede mostrar una cifra algo menor

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Ganancia media	107.53	• Medido	
Pérdida media	-90.89	• Medido	
Ratio ganancia/pérdida media	1.18	• Medido	Ganancia media / pérdida media
Peso de la mayor ganadora	0.61%	• Medido	Mayor ganadora / beneficio bruto
Máximo de ganadoras seguidas	12	• Medido	
Máximo de perdedoras seguidas	7	• Medido	
Racha máxima normal por azar	8	• Medido	Mediana de la racha perdedora más larga con el mismo porcentaje de perdedoras, en orden al azar
Racha máxima por azar, 1 de cada 20	11	• Medido	Racha perdedora que el azar alcanza 1 de cada 20 veces, con el mismo porcentaje de perdedoras
Probabilidad de una racha así por azar	90.27%	• Medido	Probabilidad de una racha perdedora al menos así de larga, con el mismo porcentaje de perdedoras
Horas medias por operación	3.89	• Medido	
Horas medianas por operación	3.85	• Medido	
SQN	1.65	• Medido	Raíz(mín(N, 100)) x media / desviación del resultado bruto por operación

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Operaciones por mes	21.76	• Medido	De la primera entrada a la última salida

Largos

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Operaciones	652	• Medido	
Aciertos	53.07%	• Medido	
Resultado neto	5,783.59	• Medido	Después de los costes que el archivo detalla por operación

Cortos

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Operaciones	630	• Medido	
Aciertos	56.35%	• Medido	
Resultado neto	11,586.16	• Medido	Después de los costes que el archivo detalla por operación

Riesgo remuestreado a un año

6.86% Drawdown máximo a un año · p50 • Medido	12.26% Drawdown máximo a un año · p95 • Medido	16.57% Drawdown máximo a un año · p99 • Medido
--	---	---

PROBABILIDAD DE UNA CAÍDA DE AL MENOS	EN LAS SIMULACIONES DEL HISTORIAL
10%	14.75% • Medido
20%	0.20% • Medido
30%	0.00% • Medido

50%

0.00% • Medido

Periodos seguidos bajo el máximo, en las simulaciones: mediana 72 • Medido, en 1 de cada 20
186.05 • Medido

¿Es normal la peor caída del archivo para estos retornos?

Peor caída del archivo: 8.2%. Con los mismos retornos en 1000 órdenes al azar, la peor caída va de 8.4% a 16.5% en 9 de cada 10 órdenes (mediana 11.4%). • Medido

Es más leve que en casi todos los órdenes al azar: solo 4.0% de ellos cae tan poco. Las pérdidas siguieron a otras pérdidas menos de lo que daría el azar. Así se ven las curvas suavizadas, las que promedian posiciones perdedoras o un orden favorable que no tiene por qué repetirse. La caída del archivo puede quedarse corta como medida del riesgo.

Cambiar el orden no cambia el Sharpe, la volatilidad ni el resultado final: solo muestra qué caída suelen traer estos retornos a lo largo de todo el archivo. No es la caída a un año de la tabla de arriba.

Supuestos:

- Estimación remuestreada del historial aportado: no es una predicción.
- Supone que el futuro se parece al historial; si el mercado cambia, la estimación no vale.
- Una curva de cierres diarios no muestra el drawdown flotante dentro del día.

¿Pico aislado o meseta?

Comparamos la configuración elegida con las que están a un paso en cada parámetro dentro de tu archivo de optimización. Si al mover un parámetro un paso el resultado se hunde, la configuración se ajustó al ruido del historial.

Elegida: la pasada con más beneficio, porque el informe no trae entradas que coincidan con una pasada.

FastMA 24

SlowMA 55

91%

Del beneficio elegido que conservan los vecinos (mediana). • Medido

100%

De los vecinos que ganan. • Medido

• Meseta

Los vecinos conservan buena parte del resultado: parece una meseta.

Vecinos a un paso

PARÁMETRO	VALOR	BENEFICIO
FastMA	23	118.00
SlowMA	54	99.00

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Beneficio de la configuración elegida	119.00	• Medido	De las filas de la exportación de optimización
Pasadas de la optimización	120	• Medido	De las filas de la exportación de optimización
Pasadas con beneficio	99.17%	• Medido	De las filas de la exportación de optimización
Posición de la elegida (percentil superior)	0.83%	• Medido	Puesto de la pasada elegida / pasadas
Vecinos encontrados	2	• Medido	De las filas de la exportación de optimización
Vecinos con beneficio	100.00%	• Medido	De las filas de la exportación de optimización
Beneficio que conservan los vecinos	91.18%	• Medido	Beneficio mediano de los vecinos / beneficio elegido

Si en el probador de MT5 activas el periodo forward y subes esa optimización, el informe añade «¿Aguanta en el periodo forward?»: compara cada configuración en el periodo optimizado y en uno posterior que el optimizador no usó para elegir.

¿Cuánto queda al descontar la suerte?

Cuantas más configuraciones se prueban, más alto sale la mejor aunque ninguna tenga ventaja. Aquí ponemos el Sharpe del archivo junto al que daría la pura suerte con las configuraciones contadas, con la matemática publicada de Bailey y López de Prado y de Harvey y Liu. Es la misma cuenta que decide la dimensión «Número de configuraciones probadas», dicha en números.

• **Supera a la suerte, sin margen**

El Sharpe de 1.79 supera al 1.19 que darían 120 configuraciones sin habilidad, pero no con el margen que pedimos: la confianza de que no sea suerte (DSR) es del 90%, y para aprobar esta dimensión pedimos 95%.

1.19

Sharpe que darían 120 configuraciones sin habilidad (el del archivo: 1.79) **Medido**

2.2 años

Años de historial con los que esa suerte queda por debajo de este Sharpe (el archivo tiene 4.9 años) **Medido**

1.16

Sharpe que queda tras descontar 120 configuraciones (Harvey y Liu) **Medido**

CONFIGURACIONES PROBADAS	SHARPE QUE DARÍA LA SUERTE	HISTORIAL NECESARIO	¿ALCANZA ESTE HISTORIAL?
10	0.72	10 meses	sí
100	1.16	2.1 años	sí
1,000	1.49	3.4 años	sí

E[Sharpe máximo] de intentos sin habilidad (Bailey y López de Prado); longitud mínima del backtest (Bailey, Borwein, López de Prado y Zhu); descuento de Bonferroni (Harvey y Liu).

Qué capital necesita y a qué tamaño

Cuánto dinero hace falta para que un año malo no se lleve más de cierto porcentaje de la cuenta, con las operaciones de este archivo. Sorteamos 2,000 años de operaciones al azar y tomamos la caída que solo un 5 % de ellos supera, o la del propio historial si es mayor.

2,442.59

Caída de referencia en dinero, al tamaño del backtest.

• Medido

1,528.76

Mayor caída del historial en su propio orden.

• Medido

261

Operaciones cerradas por año en el historial

• Medido

SI ACEPTAS
PERDER HASTA 10%

24,425.89

Capital necesario al tamaño del backtest

0.41x

Tamaño sobre el balance inicial del archivo (10,000)

SI ACEPTAS
PERDER HASTA 20%

12,212.94

Capital necesario al tamaño del backtest

0.82x

Tamaño sobre el balance inicial del archivo (10,000)

SI ACEPTAS
PERDER HASTA 30%

8,141.96

Capital necesario al tamaño del backtest

1.2x

Tamaño sobre el balance inicial del archivo (10,000)

SI ACEPTAS
PERDER HASTA 50%

4,885.18

Capital necesario al tamaño del backtest

2.0x

Tamaño sobre el balance inicial del archivo (10,000)

1x es el tamaño de lote del backtest; 0.50x es la mitad. Por encima de 1x la caída en dinero crece en la misma proporción.

Solo cuenta operaciones cerradas: las pérdidas de las posiciones mientras seguían abiertas no entran, así que el capital necesario puede ser mayor.

Supuestos:

- Tamaños fijos: sin interés compuesto ni cambios de tamaño tras ganar o perder.
- Las operaciones se sortean de forma independiente; la caída del propio historial cubre las rachas.
- Los costes son los que detalla el archivo subido.
- Las cifras en dinero van al tamaño que usó el archivo; el tamaño relativo se calcula sobre su balance inicial, sin sumar depósitos posteriores.
- Mide las pérdidas del historial; no es una predicción.

Simulador de reto de prop firm

Reglas simuladas: Genérico · Evaluación en dos fases, fase 1. Reglas de referencia genéricas, no las de una firma concreta.

RESULTADO	EN LAS SIMULACIONES DEL HISTORIAL
Llega al objetivo	89.56% • Medido
Rompe la pérdida diaria	0.00% • Medido
Rompe la pérdida total	2.28% • Medido
No termina a tiempo	8.16% • Medido

88.7% – 90.4%

Intervalo del 95 % de llegar al objetivo

Medido

58 / 92 / 138

Días hábiles hasta el objetivo
(p25 / p50 / p75)

Medido

- Reglas de referencia típicas de las evaluaciones en dos fases; no son las de ninguna firma concreta.

Supuestos:

- Estimación remuestreada del historial aportado: no es una predicción.
- Con datos diarios no se ve el drawdown flotante intradía, así que la estimación es optimista frente a los límites diarios y totales.
- Supone que el futuro se parece al historial y que cada día con retorno distinto de cero cuenta como día operado.

¿Con qué firma encaja tu historial?

El mismo historial, remuestreado igual, con las reglas publicadas de cada firma, de más a menos probabilidad de pasar todas las fases del programa dentro de la regla del mejor día, si la firma la tiene; a igual cifra, por nombre. Compara reglas; no recomienda comprar ningún reto.

Medido

RETO	PASA	PASA DENTRO DE LA REGLA DEL MEJOR DÍA	LO QUE MÁS LO TUMBA
FundedNext · Stellar 2-Step 2 fases	90%	sin regla	No termina a tiempo
FundedNext · Stellar Lite 2 fases	88%	sin regla	Rompe la pérdida total
FTMO · FTMO Challenge 2-Step 2 fases	87%	sin regla	No termina a tiempo
The5ers · High Stakes 2 fases	87%	sin regla	No termina a tiempo
The5ers · Hyper Growth 1 fase	86%	sin regla	Rompe la pérdida total

RETO	PASA	PASA DENTRO DE LA REGLA DEL MEJOR DÍA	LO QUE MÁS LO TUMBA
FTMO · FTMO Challenge 1 - Step 1 fase	82%	82%	Rompe la pérdida diaria
FundedNext · Stellar 1 - Step 1 fase	80%	sin regla	Rompe la pérdida total
The5ers · Bootcamp 3 fases	64%	sin regla	Rompe la pérdida total
Topstep · Trading Combine 50K 1 fase	60%	60%	Rompe la pérdida total
Topstep · Trading Combine 100K 1 fase	50%	50%	Rompe la pérdida total
Topstep · Trading Combine 150K 1 fase	50%	50%	Rompe la pérdida total

Preguntas para hacerle al vendedor

1. ¿Hay una cuenta real o demo con al menos 11 meses de historial auditable con el mismo robot y la misma configuración?
2. ¿Con qué modo de modelado y calidad de históricos se hizo el backtest (ticks reales, 1 minuto OHLC, solo precios de apertura)?
3. ¿Qué spread, comisión y swap se usaron? ¿Son los de su bróker?
4. Pide la curva de equity (flotante), no solo la de balance: el balance oculta las pérdidas abiertas.

Detalle técnico de cada dimensión

DIMENSIÓN	ESTADO	RAZONES
Significación estadística	Supera	PSR 1.000 >= 0.95; Sharpe p5 del bootstrap > 0

Número de configuraciones probadas	● Débil	DSR 0.905 entre 0.5 y 0.95 con 120 intentos contados en los archivos
Costes	● Débil	El resultado neto a 1x es 6,441.05 > 0 pero a 3x es -15,404.86 <= 0
Fuera de muestra	● Débil	Sharpe fuera de muestra 0.54 > 0; diferencia 1.35
Calidad de datos y forma de operar	● Supera	Sin banderas rojas
Benchmark	● No aplica	El cliente declaró que no aplica benchmark

Umbral aplicados: PSR para superar 0.95 · PSR mínimo 0.8 · DSR para superar 0.95 · DSR mínimo 0.5 · PBO máximo 0.5 · múltiplo de coste que debe aguantar 3 · Sharpe fuera de muestra mínimo 0.5 · caída máxima del Sharpe fuera de muestra 1 · drawdown máximo frente al benchmark (veces) 1

Rendimiento anualizado

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Retorno total	173.70%	● Medido	
Retorno anual compuesto	22.75%	● Medido	
Volatilidad anual	11.86%	● Medido	
Sharpe	1.79	● Medido	
Sortino	2.80	● Medido	
Drawdown máximo	-8.22%	● Medido	

Significación estadística

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Observaciones	1,282	● Medido	
Sharpe por periodo	0.1107	● Medido	

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Asimetría	0.0974	• Medido	
Curtosis	4.33	• Medido	
Sharpe probabilístico (PSR)	100.00%	• Medido	P[Sharpe real > 0] dada la longitud, la asimetría y la curtosis
Historial mínimo necesario	222	• Medido	Observaciones necesarias para que el PSR llegue a 0.95
Observaciones que faltan	0	• Medido	

Sharpe corregido por autocorrelación (Lo, 2002): no queda apreciablemente por debajo de 1.79, así que el orden de los retornos no infla el Sharpe simple de forma apreciable. Si la corrección lo sube, el informe no la usa, para no favorecer al archivo. • Medido

Los retornos no dependen de forma apreciable unos de otros: tenerlo en cuenta no cambia la probabilidad de que el Sharpe real sea mayor que cero. • Medido

Multiplicidad (número de intentos)

Intentos usados en el Sharpe deflactado: 120 • Medido pasadas de la exportación de optimización de MT5

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Intentos usados	120	• Medido	Pasadas de la exportación de optimización de MT5
Varianza del Sharpe usada	0.0008	• Medido	
Mínimo por error de muestreo	0.0008	• Medido	Varianza de muestreo del estimador de Sharpe
Aumento de la varianza por dependencia	1.03	• Medido	Cuántas veces crece la varianza del Sharpe cuando los retornos no se toman como independientes (1 significa sin cambio)
Observaciones efectivas tras dependencia	1,244	• Medido	

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Observado en las variantes	—	• No medido	No se subió la matriz de variantes
DSR con los intentos declarados	90.49%	• Medido	PSR frente a E[Sharpe máximo] de 120 intentos
DSR con los intentos usados	90.49%	• Medido	PSR frente a E[Sharpe máximo] de 120 intentos, pasadas de la exportación de optimización de MT5
Intentos que bajan el DSR a 0.5	16,384	• Medido	Menor número de intentos, en potencias de dos, con DSR < 0.5

Varianza usada: la mayor entre la observada en las variantes que subiste y la que produce el error de muestreo.

INTENTOS	SHARPE MÁXIMO ESPERADO SIN HABILIDAD	SHARPE DEFLACTADO (DSR)
1	0	100.00%
5	0.0338	99.67%
20	0.0539	97.74%
100	0.0717	91.52%
120	0.0735	90.49%

Bootstrap estacionario (por período)

Bootstrap estacionario por bloques, remuestreos: 500 · bloque 20

	ESTIMACIÓN	P5	P50	P95
Sharpe por periodo	0.1107 • Medido	0.0688 • Medido	0.1109 • Medido	0.1513 • Medido
Retorno total	173.70% • Medido	84.39% • Medido	171.78% • Medido	302.55% • Medido

Fuera de muestra declarado

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Inicio fuera de muestra	2024-06-03	• Declarado	Declarado por el cliente; no se puede comprobar
Diferencia de Sharpe (dentro menos fuera)	1.35	• Medido	Sharpe anualizado dentro de muestra menos fuera de muestra

En muestra

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Observaciones	1,152	• Medido	
Sharpe anualizado	1.89	• Medido	
Sharpe probabilístico (PSR)	100.00%	• Medido	
Retorno total	168.44%	• Medido	

Fuera de muestra

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Observaciones	130	• Medido	
Sharpe anualizado	0.5448	• Medido	
Sharpe probabilístico (PSR)	64.96%	• Medido	
Retorno total	1.96%	• Medido	

Costes de operación

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Coste de referencia (pb por lado)	1	• Declarado	Declarado por el cliente; se cobra además de los costes que desglosa el informe
Coste de equilibrio (pb por lado)	1.59	• Medido	Coste extra por lado, además de los costes del informe, con el que el resultado queda en cero
Múltiplo de coste de equilibrio	1.59	• Medido	

MULTIPLICADOR	PB POR LADO	BRUTO	COSTE	NETO	ACIERTOS	OPERACIONES
0x	0.00	26,338.00	8,974.00	17,364.00	54.68%	1,282
1x	1.00	26,338.00	19,896.95	6,441.05	51.48%	1,282
2x	2.00	26,338.00	30,819.91	-4,481.91	48.52%	1,282
3x	3.00	26,338.00	41,742.86	-15,404.86	45.40%	1,282

Esta tabla recalcula cada operación con sus precios y su tamaño: sin coste extra da 17,364.00, 5.75 de diferencia con el resultado neto de las operaciones (17,369.75), por el redondeo de precios o la conversión de divisa.

Costes que detalla el informe

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Comisión	-8,974.00	• Medido	Total con signo que desglosa el informe; negativo es un coste
Swap	0.00	• Medido	Total con signo que desglosa el informe; negativo es un coste

Benchmark aportado

• No medido

 no se subió un benchmark

Sobreajuste por validación cruzada combinatoria (CSCV)

• No medido

 no se subió la matriz de variantes

Subperíodos (años naturales)

AÑO	RETORNO	DRAWDOWN MÁXIMO
2020	38.28%	-8.22%
2021	24.87%	-6.66%
2022	27.42%	-5.18%
2023	17.40%	-4.30%
2024	5.96%	-5.63%

Ventanas móviles

VENTANA	RETORNO MÍNIMO	DRAWDOWN MÍNIMO	FRACCIÓN NEGATIVA
65	-4.68%	-8.22%	14.37%
131	-3.29%	-6.87%	2.78%
261	3.66%	-6.66%	0.00%

Banderas rojas

 Sin banderas rojas en los archivos auditados.

Archivos auditados (sha256)

report.html	f07658c4049d4cc344aece0211cf60babe77cc06eae6a9f554bf4b1a804f75b
optimization.xml	49227a5fca40ead53d2020bad7b4f19f8723bc7ef6d4079e7ff791e2fce72626
live.csv	0648d915126fac0966c5ca86aae7b6a1f10fc8b03b5f7233e1032d070c1b9a4b
Huella del conjunto de datos	ced13c6f8a82d6d27bb49448ed86dec90c021c7d46baa31f69d86566e35eaf55

Avisos de lectura

- informe: tamaño de contrato deducido del beneficio del informe: AUDUSD x100,000, EURUSD x100,000
- informe: las horas del archivo no indican zona horaria (hora de la plataforma o del servidor); se leyeron como UTC
- informe: la curva de balance se construye solo con operaciones cerradas; no muestra el drawdown flotante (de las operaciones abiertas), así que el drawdown real fue al menos igual de profundo
- optimización: el número de pasadas es el de configuraciones que probó el optimizador; una optimización genética solo lista las pasadas que evaluó
- cuenta real: tamaño de contrato deducido del beneficio del informe: AUDUSD x100,000, EURUSD x100,000
- cuenta real: se quitaron depósitos y retiros: la curva es un índice ajustado por flujos que empieza en el balance inicial
- cuenta real: las horas del archivo no indican zona horaria (hora de la plataforma o del servidor); se leyeron como UTC
- cuenta real: la curva de balance se construye solo con operaciones cerradas; no muestra el drawdown flotante (de las operaciones abiertas), así que el drawdown real fue al menos igual de profundo

Formato del archivo: MetaTrader 5 Strategy Tester (HTML)

Exportación de optimización: 120 configuraciones probadas • Medido

Datos que declara la plataforma • Declarado

Balance chain breaks	0
Fin	2024-11-29
Largest balance difference	0.000000
Periodo	H1 (2020.01.02 - 2024.11.29)
Reconstructed final balance	27369.750000
Reported final balance	27369.750000
Inicio	2020-01-02
Estrategia	SyntheticSampleEA

Símbolo	EURUSD
---------	--------

Declarado por el cliente

MÉTRICA	VALOR	EVIDENCIA	NOTA
Intentos	120	• Declarado	
Coste por lado (pb)	1.00	• Declarado	
Inicio fuera de muestra	2024-06-03	• Declarado	
Aplica benchmark	no	• Declarado	
Balance inicial	—	• No medido	No declarado

No se escribió una descripción de la estrategia.

No medido

Benchmark aportado No se subió un benchmark.
Sobreajuste por validación cruzada combinatoria (CSCV) No se subió la matriz de variantes.

Sello del holdout declarado

Identificador del sello	sample
Inicio de la selección	2020-01-01
Fin de la selección	2024-06-02T23:59:59Z
Inicio del tramo reservado	2024-06-03
Fin del tramo reservado	2024-11-29
Sellado (UTC)	2026-09-24

Sello (sha256)

6c8325dd86a2f85c1c008ce937dc7426a1984a5d2f7ccc27a3a322c9e60a8fcc

Aviso. Esta auditoría es una herramienta de investigación estadística aplicada a datos aportados por el cliente. No es asesoría de inversión, no ejecuta operaciones, no custodia fondos ni claves, y no predice resultados futuros. Cada valor lleva su etiqueta de evidencia: Medido se calculó desde el archivo, Declarado lo afirmó el cliente y no se pudo verificar, No medido no se pudo calcular con lo aportado.

sha256 del JSON de la auditoría

49d2637c68c7c799ad0dbd5a54d84f60134df8dd36a44c6ebf523a233ce6150a

Rigor · Auditoría estadística independiente de backtests e historiales

[Términos del servicio](#) [Política de privacidad](#)