Patrón de comportamiento del precio el mes siguiente después de un máximo de 52 semanas

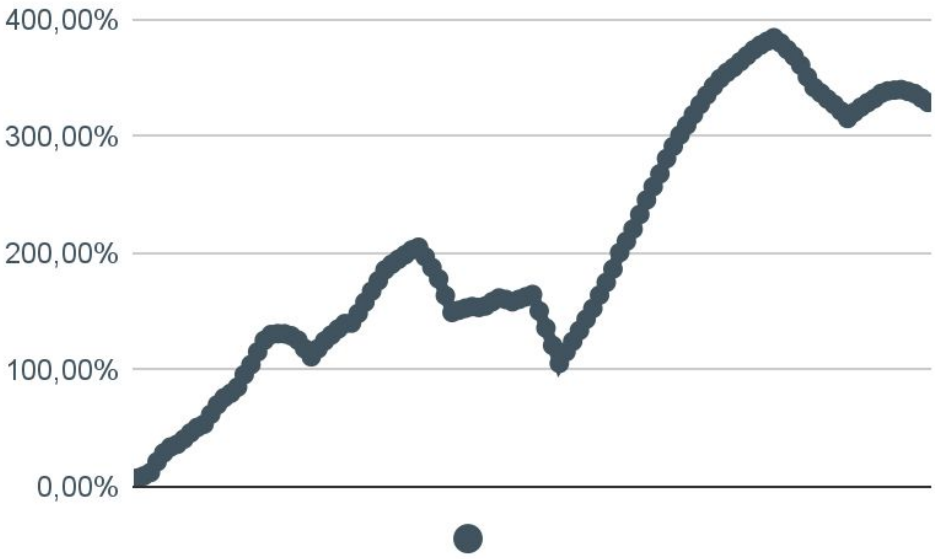
Auto trader Group (FTSE)

2014

8 años

RIESGO	RENTABILIDAD	FIABILIDAD	MUESTRA	PUNTUACIÓN
6,5	9	6	5	6,625 sobre 10

Rentabilidad acumulada



Rentabilidad total
329,18%

Máxima pérdida
-15,33%

Operaciones positivas
73,11%

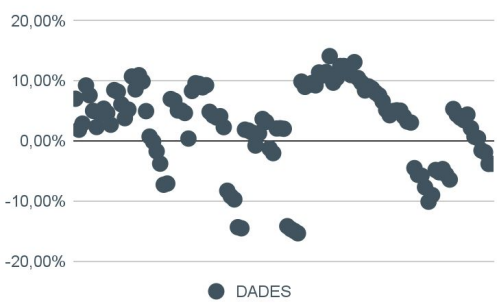
Volatilidad de las operaciones
6,98%

Rentabilidad esperada por operación
1,75%

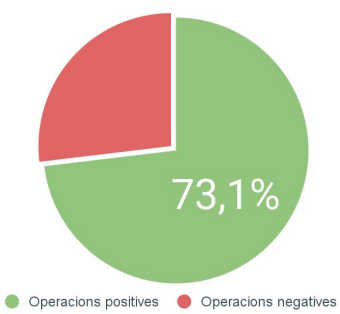
EXPLICACIÓN

Patrón de comportamiento del precio los 30 dias siguientes después de un máximo anual del precio.. El acierto de la estrategia es del 73%, la rentabilidad esperada es del 1,75%. La rentabilidad de las operaciones positivas es 2,5 veces superior a las negativas. La volatilidad de las operaciones es del 6,98% y el resultado de la estrategia es del 329% desde el año 2014.

DISPERSIÓN DE LES OPERACIONES



ACIERTO DE LA ESTRATEGIA



Patrón de comportamiento del precio el mes siguiente después de un máximo de 52 semanas

Auto trader Group (FTSE)

Rentabilidad		Muestra		Riesgo	
Mejor operación	14,11%	Núm Años	8	Máxima pérdida	-15,33%
Operaciones consecutivas con ganancias	32	Operaciones positivas	73,11%	Probabilidad esperada de fracaso	34,59%
Rentabilidad operaciones consecutivas con ganancias	279,00%	Operaciones negativas	26,89%	Probabilidad esperada de éxito	65,41%
Rentabilidad media operaciones	2,77%	Número operaciones de la muestra	119	Operaciones consecutivas con pérdidas	11
Rentabilidad media operaciones positivas	6,30%	Suma de las operaciones positivas	548,34%	Rentabilidad operaciones consecutivas con pérdidas	-69,00%
Rentabilidad media operaciones negativas	-6,85%	Suma de las operaciones negativas	-219,16%		
Ratio profit lost	0,92				
Ratio profit factor	2,50				
Ratio recovery factor	21,47				

TABLA ÚLTIMAS 10 OPERACIONES

Últimas operaciones	Fecha Compra	Fecha venda	Rentabilidad
1	16/7/21		-3,78%
2	13/7/21		-3,80%
3	7/7/21		-1,87%
4	6/7/21		-1,57%
5	25/6/21		0,49%
6	24/6/21		0,71%
7	23/6/21		2,13%
8	22/6/21		4,40%
9	16/6/21		3,48%
10	14/6/21		3,87%

LEYENDA

Profit factor: Suma de las operaciones positivas / suma de las operaciones negativas (tiene que ser superior a 1)
Rati profit los: Rentabilidad media de las operaciones positivas / rentabilidad media de las operaciones negativas (tiene que ser superior a 1)
Recovery factor: Rentabilidad total / máxima pérdida (tiene que ser superior a 6)
VaR 95%: Máxima pérdida esperada en un operación, con una confianza estadística del 95%
*Rentabilidad esperada: Probabilidad de ganancia * rentabilidad media de las operaciones positivas - Probabilidad de pérdida * rentabilidad media de las operaciones negativas*
Probabilidades esperadas: Distribución normal standar de la rentabilidad media en función de la volatilidad de las operaciones