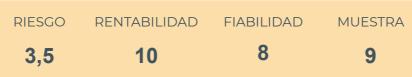
Patrón de comportamiento del precio los 3 meses siguientes después de un máximo de 52 semanas

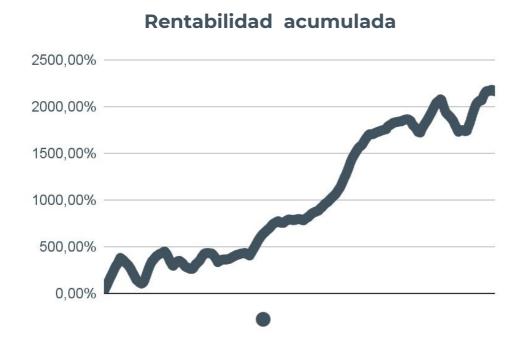
Lam Research copr (Nasdaq 100)

muestra de 369 operaciones **Análisis desde el**

2003



7,625sobre 10





Máxima pérdida -35,94%

Operaciones positivas

71,27%

Volatilidad de las operaciones

14,11%

Rentabilidad esperada por operación

4,61%

EXPLICACIÓN

Patrón de comportamiento del precio los 3 meses siguientes después de un máximo de 52 semanas. El acierto de la estrategia es del 71%, la rentabilidad esperada es del 4,61%. La rentabilidad de las operaciones positivas es 2,8 veces superior a las negativas. La volatilidad de las operaciones es del 14% y el resultado de la estrategia es del 2163% desde el año 2003.



ACIERTO DE LA ESTRATEGIA



Patrón de comportamiento del precio los 3 meses siguientes después de un máximo de 52 semanas Lam Research copr (Nasdaq 100)

Rentabilidad		Muestra		Riesgo	
Mejor operación	38,82%	Núm Años	18	Máxima pérdida	-35,94%
Operaciones consecutivas con ganancias	63	Operaciones positivas	71,27%	Probabilidad esperada de fracaso	33,92%
Rentabilidad operaciones consecutivas con ganancias	923,00%	Operaciones negativas	28,73%	Probabilidad esperada de éxito	66,08%
Rentabilidad media operaciones	5,86%	Número operaciones de la muestra	369	Operaciones consecutivas con pérdidas	20
Rentabilidad media operaciones		Suma de las operaciones		Rentabilidad operaciones consecutivas con	
positivas	12,79%	positivas	3364,64%	pérdidas	-276,00%
Rentabilidad media operaciones negativas	-11,33%	Suma de las operaciones negativas	-1200,69%		
Ratio profit lost	1,13				
Ratio profit factor	2,80				
Ratio recovery factor	60,21				

TABLA ÚLTIMAS 10 OPERACIONES

Íltimas operaciones	Fecha Compra	Fecha venda	Rentabilidad
	8/4/21	90 dias después	-8,26%
2	5/4/21	90 dias después	-5,89%
3	1/4/21	90 dias después	-1,23%
4	1/3/21	90 dias después	8,38%
5	19/2/21	90 dias después	4,73%
5	16/2/21	90 dias después	0,05%
7	12/2/21	90 dias después	-0,24%
3	19/1/21	90 dias después	5,69%
9	14/1/21	90 dias después	16,44%
0	12/1/21	90 dias después	20,24%

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

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