Patrón estacional del precio en diciembre

Lululemon Athletica (Masdaq 100)

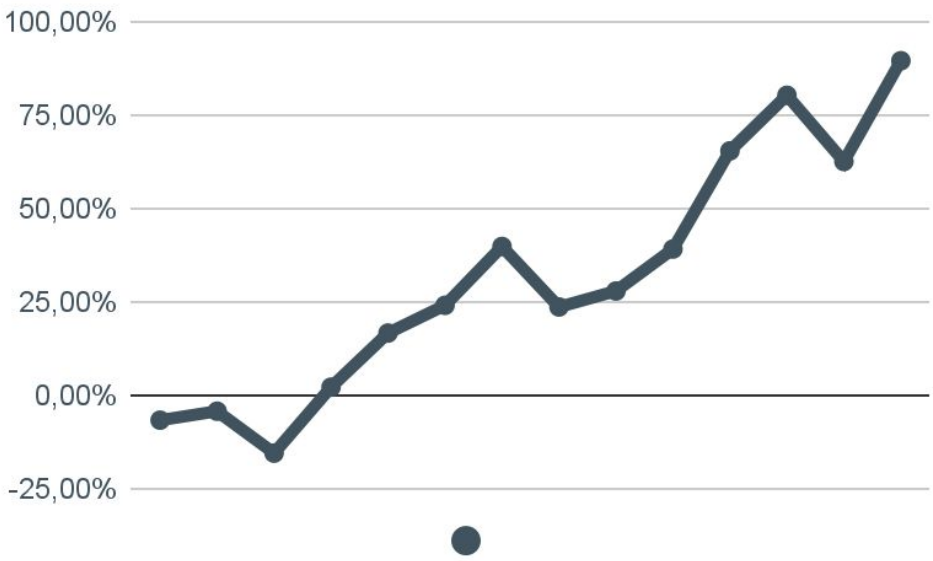
14 operaciones

Análisis desde el 2014

RIESGO	RENTABILIDAD	FIABILIDAD	MUESTRA
1,5	9	10	6,5

PUNTUACIÓN
6,75
sobre 10

Rentabilidad acumulada



Rentabilidad total
89,57%

Máxima pérdida
-17,74%

Operaciones positivas
71,43%

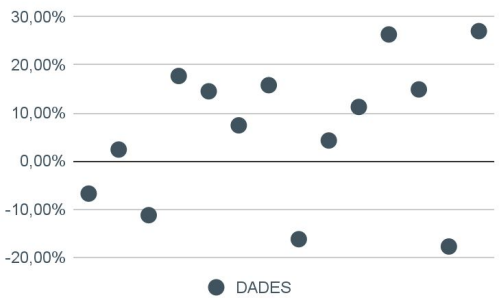
Volatilidad de las operaciones
14,67%

Rentabilidad esperada por operación
5,16%

EXPLICACIÓN

Patrón estacional del precio en diciembre . El acierto de la estrategia es del 71%, la rentabilidad esperada es del 5%. La rentabilidad de las operaciones positivas es 2,7 veces superior a las negativas. La volatilidad de las operaciones es del 14% y el resultado de la estrategia es del 89% desde el año 2000.

DISPERSIÓN DE LES OPERACIONES



ACIERTO DE LA ESTRATEGIA

Patrón estacional del precio en diciembre
Lululemon Athletica (Masdaq 100)

Rentabilidad		Muestra		Riesgo	
Mejor operación	27,00%	Núm Años	14	Máxima pérdida	-17,74%
Operaciones consecutivas con ganancias	4	Operaciones positivas	71,43%	Probabilidad esperada de fracaso	33,13%
Rentabilidad operaciones consecutivas con ganancias	56,00%	Operaciones negativas	28,57%	Probabilidad esperada de éxito	66,87%
Rentabilidad media operaciones	6,40%	Número operaciones de la muestra	14	Operaciones consecutivas con pérdidas	1
Rentabilidad media operaciones positivas	14,15%	Suma de las operaciones positivas	141,51%	Rentabilidad operaciones consecutivas con pérdidas	-17,00%
Rentabilidad media operaciones negativas	-12,99%	Suma de las operaciones negativas	-51,94%		
Ratio profit lost	1,09				
Ratio profit factor	2,72				
Ratio recovery factor	5,05				

TABLA ÚLTIMAS 10 OPERACIONES

Últimas operaciones	Fecha Compra	Fecha venda	Rentabilidad
1	1/12/20	31/12/20	-6,75%
2	2/12/19	31/12/19	2,40%
3	3/12/18	31/12/18	-11,23%
4	1/12/17	29/12/17	17,68%
5	1/12/16	30/12/16	14,50%
6	1/12/15	31/12/15	7,43%
7	1/12/14	31/12/14	15,77%
8	2/12/13	31/12/13	-16,22%
9	3/12/12	31/12/12	4,28%
10	1/12/11	30/12/11	11,25%

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