Patrón estacional del 13-12 al 31-12

Plata

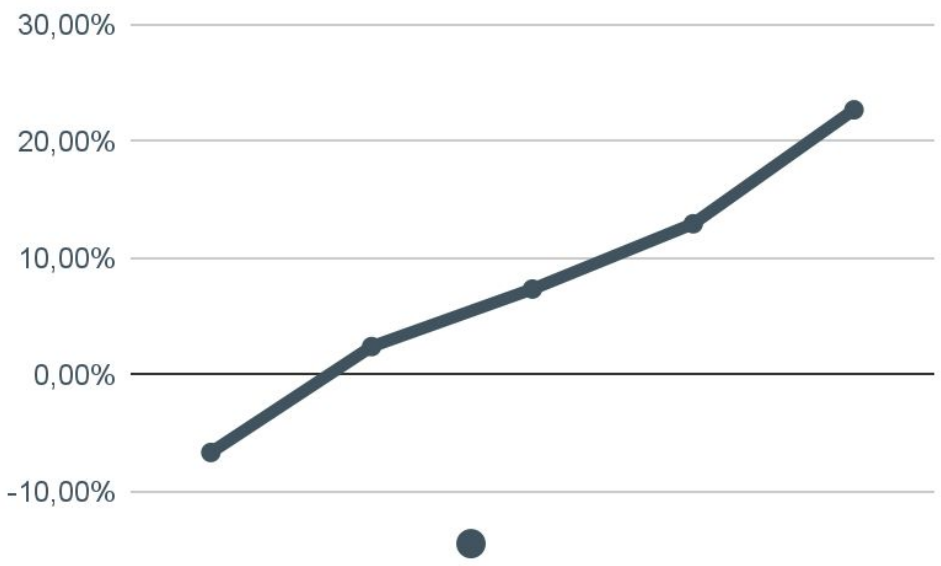
muestra de 5 operaciones

Análisis desde el 2016

RIESGO	RENTABILIDAD	FIABILIDAD	MUESTRA
5,25	7	8	6

PUNTUACIÓN
6,5625
sobre 10

Rentabilidad acumulada



Rentabilidad total
22,71%

Máxima pérdida
-6,67%

Operaciones positivas
80,00%

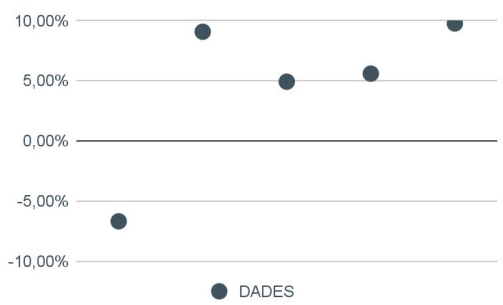
Volatilidad de las operaciones
6,61%

Rentabilidad esperada por operación
3,90%

EXPLICACIÓN

ENTRADA DIA 13 DE DICIEMBRE 2021, SALIDA 31 DE DICIEMBRE 2021.Patrón de comportamiento del precio los últimos 15 días de diciembre. . El acierto de la estrategia es del 80%, la rentabilidad esperada es del 3,9%. La rentabilidad de las operaciones positivas es 4 veces superior a las negativas. La volatilidad de las operaciones es del 6,6% y el resultado de la estrategia es del 22% desde 2016.

DISPERSIÓN DE LES OPERACIONES



ACIERTO DE LA ESTRATEGIA

Patrón estacional del 13-12 al 31-12

Plata

Rentabilidad		Muestra		Riesgo	
Mejor operación	9,77%	Núm Años	5	Máxima pérdida	-6,67%
Operaciones consecutivas con ganancias	4	Operaciones positivas	80,00%	Probabilidad esperada de fracaso	24,61%
Rentabilidad operaciones consecutivas con ganancias	29,00%	Operaciones negativas	20,00%	Probabilidad esperada de éxito	75,39%
Rentabilidad media operaciones	4,54%	Número operaciones de la muestra	5	Operaciones consecutivas con pérdidas	1
Rentabilidad media operaciones positivas	7,35%	Suma de las operaciones positivas	29,38%	Rentabilidad operaciones consecutivas con pérdidas	-6,00%
Rentabilidad media operaciones negativas	-6,67%	Suma de las operaciones negativas	-6,67%		
Ratio profit lost	1,10				
Ratio profit factor	4,40				
Ratio recovery factor	3,40				

TABLA ÚLTIMAS 10 OPERACIONES

Últimas operaciones	Fecha Compra	Fecha venda	Rentabilidad
1	13/12/20	31/12/20	9,77%
2	13/12/19	31/12/19	5,60%
3	13/12/18	31/12/18	4,93%
4	13/12/17	29/12/17	9,08%
5	13/12/16	30/12/16	-6,67%
6			
7			
8			
9			
10			

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

Patrón estacional del 01-01 al 31-01

Plata

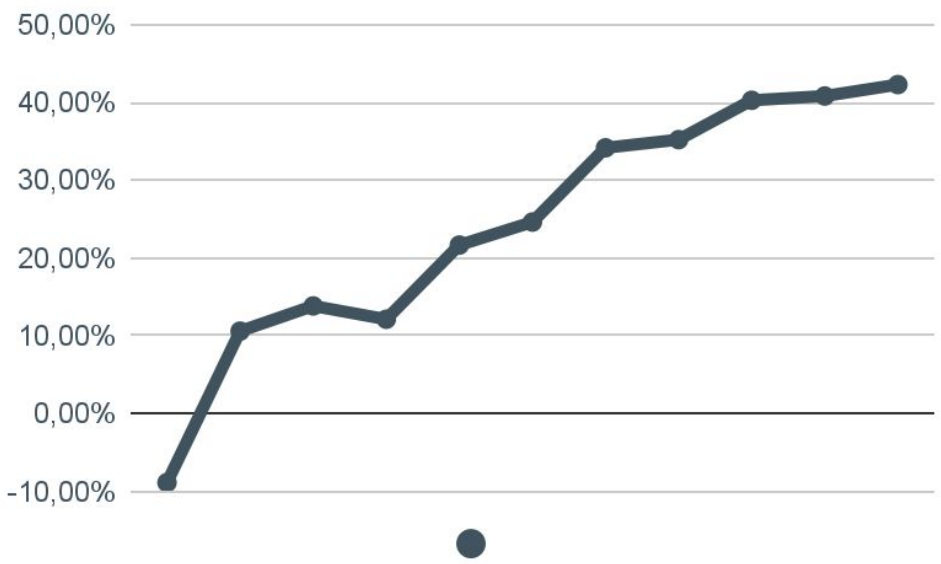
muestra de 11 operaciones

Análisis desde el 2011

RIESGO	RENTABILIDAD	FIABILIDAD	MUESTRA
4,5	7	8	7,5

PUNTUACIÓN
6,75
sobre 10

Rentabilidad acumulada



Rentabilidad total
42,31%

Máxima pérdida
-8,88%

Operaciones positivas
81,82%

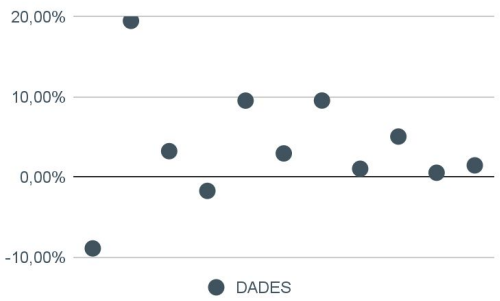
Volatilidad de las operaciones
7,27%

Rentabilidad esperada por operación
3,79%

EXPLICACIÓN

ENTRADA DIA 01 DE ENERO 2022, SALIDA 31 DE ENERO 2022.Patrón de comportamiento durante enero. El acierto de la estrategia es del 81%, la rentabilidad esperada es del 3,7%. La rentabilidad de las operaciones positivas es 5 veces superior a las negativas. La volatilidad de las operaciones es del 7% y el resultado de la estrategia es del 42% desde 2011.

DISPERSIÓN DE LES OPERACIONES



ACIERTO DE LA ESTRATEGIA

Patrón estacional del 01-01 al 31-01

Plata

Rentabilidad		Muestra		Riesgo	
Mejor operación	19,48%	Núm Años	11	Máxima pérdida	-8,88%
Operaciones consecutivas con ganancias	7	Operaciones positivas	81,82%	Probabilidad esperada de fracaso	29,85%
Rentabilidad operaciones consecutivas con ganancias	30,00%	Operaciones negativas	18,18%	Probabilidad esperada de éxito	70,15%
Rentabilidad media operaciones	3,85%	Número operaciones de la muestra	11	Operaciones consecutivas con pérdidas	1
Rentabilidad media operaciones positivas	5,88%	Suma de las operaciones positivas	52,90%	Rentabilidad operaciones consecutivas con pérdidas	-8,00%
Rentabilidad media operaciones negativas	-5,30%	Suma de las operaciones negativas	-10,59%		
Ratio profit lost	1,11				
Ratio profit factor	5,00				
Ratio recovery factor	4,76				

TABLA ÚLTIMAS 10 OPERACIONES

Últimas operaciones	Fecha Compra	Fecha venda	Rentabilidad
1	2/1/11	31/1/11	-8,88%
2	2/1/12	31/1/12	19,48%
3	1/1/13	31/1/13	3,24%
4	1/1/14	31/1/14	-1,71%
5	1/1/15	30/1/15	9,54%
6	3/1/16	31/1/16	2,96%
7	2/1/17	31/1/17	9,55%
8	1/1/18	31/1/18	1,05%
9	1/1/19	31/1/19	5,06%
10	1/1/20	31/1/20	0,55%

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