

# Proyecto Trading Agentic

## Guia de Estrategia y Operaciones para Maximiliano

Febrero 2026

*Documento confidencial - Equipo de Desarrollo*

# 1. Que Estamos Construyendo

Imaginate un equipo de analistas que trabajan 24/7 leyendo papers academicos de trading, extrayendo las mejores estrategias, y armando un manual de operaciones. Despues, ese manual se lo damos a un bot que opera en el mercado de Bitcoin siguiendo esas instrucciones.

**Eso es exactamente lo que estamos construyendo, pero con inteligencia artificial.**

El sistema tiene dos grandes partes:

- 1. El Investigador (Fase 1):** Una IA que lee papers de trading, entiende las estrategias, y genera una guia maestra de operaciones.
- 2. El Trader (Fase 2):** Un bot que usa esa guia para operar BTC en modo simulado (paper trading en Binance Testnet, sin dinero real).

## Por que empezamos por la investigacion?

Muchos bots de trading fracasan porque alguien programa una estrategia que 'le parece buena' sin evidencia solida. Nosotros hacemos lo contrario: primero investigamos que funciona con datos reales de papers academicos, despues sintetizamos todo en una estrategia probada, y recien ahi le damos esa estrategia al bot.

**Es como en medicina: primero estudias la evidencia, despues tratas al paciente.**



Infograma 1: Vision general del sistema de investigacion y trading

## 2. Los 3 Agentes de Investigacion

---

### Agente 1: El Curador de Fuentes

Evalua si un paper o articulo vale la pena leerlo. Le damos una URL y el agente lo evalua en 4 dimensiones: Relevancia (habla de BTC?), Credibilidad (esta publicado en un journal serio?), Aplicabilidad (se puede implementar con ~\$10K?), y Actualidad (datos recientes?).

Si el score promedio es 6 o mas, lo aprueba. Si no, lo descarta y explica por que.

### Agente 2: El Lector de Papers

Lee cada paper aprobado y extrae informacion estructurada: estrategias de trading con todos los detalles (indicadores, reglas de entrada/salida, resultados de backtest, limitaciones), insights importantes, advertencias de riesgo, y contradicciones con otros papers.

### Agente 3: El Sintetizador

El mas importante. Toma TODO lo que extrajeron los papers y genera la 'Guia Maestra de Trading'. Encuentra patrones comunes ('5 de 8 papers dicen que RSI adaptativo funciona mejor'), resuelve contradicciones (da mas peso al paper con mejor backtest y datos mas recientes), rankea estrategias por evidencia acumulada, y genera un documento que dice exactamente que hacer.

**Cada vez que agregamos nuevos papers, se regenera la guia. El bot se actualiza automaticamente.**

### 3. Estrategia de Trading Completa

---

#### Contexto General

Parametro	Valor
Par de trading	BTCUSDT
Exchange	Binance Testnet (simulado)
Capital	10,000 USDT
Tamano por operacion	0.001 BTC (~\$100 USD)
Timeframe	Velas de 1 min, decisiones cada 5 min
Estilo	Intraday a swing
Leverage	Ninguno (1x)

#### Indicadores Tecnicos

Indicador	Configuracion	Uso
SMA 10	Media movil simple 10 periodos	Tendencia corto plazo
SMA 50	Media movil simple 50 periodos	Tendencia mediano plazo
RSI 14	Relative Strength Index 14p	Sobrecompra (>70) / Sobreventa (<30)
Bollinger Bands	SMA 20 +/- 2 std dev	Volatilidad y extremos
Volumen Avg 20	Media volumen 20 periodos	Confirmar interes del mercado
ATR 14	Average True Range 14p	Medir volatilidad para stop-loss

## Las 4 Estrategias del Bot

### Estrategia 1: Momentum Long (compra por tendencia)

Cuando se activa: Mercado en tendencia alcista clara

Entrada: SMA 10 cruza por encima de SMA 50 + RSI entre 40-65 + Volumen >120% promedio

Salida: Take-profit +3% / Stop-loss -1.5% / RSI >75 / SMA cruce bajista

### Estrategia 2: Mean Reversion (compra en sobreventa)

Cuando se activa: Mercado lateral o despues de caida brusca

Entrada: Precio toca Bollinger inferior + RSI <25 + SMA 50 plana + Volumen decreciente

Salida: Precio llega a SMA 20 / Stop-loss -1.5% / RSI >50 / Timeout 2 horas

### Estrategia 3: Hold (no hacer nada)

Cuando se activa: RSI entre 40-60, SMAs muy cerca, volumen bajo promedio

Es la decision mas frecuente e inteligente en mercados indecisos. No forzar trades.

### Estrategia 4: Exit Position (cerrar posicion)

Se alcanzo stop-loss/take-profit, cambio de condiciones, o riesgo elevado.

## 4. Gestion de Riesgo (Automatica)

Estas reglas son **AUTOMATICAS** y **NO** las controla la IA. Son codigo fijo. Incluso si la IA dice 'compra', si se excedio un limite, no se ejecuta.

Regla	Limite	Razon
Perdida diaria maxima	-2% (\$200)	Proteger capital
Tamano de posicion	0.001 BTC (~\$100)	Max 1% del capital por trade
Posiciones abiertas	1 a la vez	No sobreexponerse
Stop-loss automatico	-1.5% desde entrada	No negociable
Take-profit automatico	+3% desde entrada	Tomar ganancia
Cooldown post-perdida	30 minutos	Evitar revenge trading
Leverage maximo	1x (sin apalancamiento)	Solo capital propio



Infograma 2: Flujo de decision del trading bot y gestion de riesgo

## 5. Testing y Validacion

---

### Fase 1: Validacion de la Investigacion

**Test con papers conocidos:** Le damos papers clasicos (Gatev sobre pairs trading, estudios de momentum en crypto) y verificamos que extraiga las estrategias correctamente.

**Test de contradicciones:** Papers que se contradicen para ver si el sintetizador resuelve el conflicto correctamente.

**Test de calidad de guia:** Maxi revisa la guia como trader. Los entry/exit rules tienen sentido? Los indicadores estan bien?

### Fase 2: Paper Trading (simulado)

El bot opera con dinero ficticio en Binance Testnet. Los precios son similares a los reales pero no hay riesgo.

Metrica	Target	Que mide
Win Rate	> 55%	% de operaciones ganadoras
Profit Factor	> 1.5	Ganancia total / Perdida total
Sharpe Ratio	> 1.0	Retorno ajustado por riesgo
Max Drawdown	< 10%	Peor caida del capital
Trades por dia	3-8	Actividad del bot

### Criterios Go/No-Go para dinero real

Win rate >55% sostenido por 2 semanas

Max drawdown <10%

Profit factor >1.5

Sin errores de sistema en 48 horas

Revision de Maxi aprobada

## 6. Tu Rol en el Proyecto, Maxi

---

### Fase 1 (ahora):

- Fuentes:** Pasanos URLs de papers y articulos de trading que consideres valiosos
- Revision de estrategias:** Validar que las estrategias extraidas tengan sentido
- Revision de la guia:** La guia maestra necesita tu ojo critico
- Feedback:** 'Este indicador esta mal', 'en mi experiencia esto no funciona asi'

### Fase 2 (despues):

- Parametros de riesgo:** Calibrar stop-loss, take-profit, position sizing
- Analisis:** Revisar trades del bot y diagnosticar que hace bien/mal
- Ajustes:** Proponer cambios basados en resultados
- Go/No-Go:** Tu aprobacion es necesaria antes de pasar a real

## 7. Cronograma

---

Semana	Que hacemos	Tu participacion
1	Setup tecnico (DB, infra)	Nada, puro codigo
2	Source Agent + Reader Agent	Pasanos 5-10 URLs de papers
3	Synthesis Agent + Dashboard + Chat	Revision de la guia maestra
4	Pulir + preparar Fase 2	Feedback final sobre estrategia
5-6	Trading Bot en testnet	Monitorear operaciones
7-8	Ajustes basados en resultados	Calibrar parametros

---

Documento generado el 15 de febrero de 2026. Se actualizara a medida que el proyecto avance.