

ESTRATEGIA BASE PARA EL TRADING SYSTEM

El trend following es una estrategia que se ha comprobado que funciona en al menos 67 mercados diferentes. Se basa en que las tendencias existentes debido a un sesgo cognitivo denominado “anchoring” y el comportamiento de la manada, además de participantes que no buscan beneficios como los Bancos Centrales.

El algoritmo sería el siguiente para la estrategia “Times Series Momentum”:

Cuando el mercado tiene una tendencia alcista-> posición larga(comprar)

Cuando el mercado tiene una tendencia bajista->posición corta (vender)

La ventaja respecto a otros modelos es que aquí siempre se tiene una posición abierta, o sea, nunca se queda fuera del mercado.

Para ser robustos, no se utiliza solo una ventana de tiempo (Look Back Windows):

Se combinan tres señales: 1 mes, 2 meses y 12 meses.

Cada posición se ajusta para tener el mismo riesgo (Volatily Scaling):

El tamaño de la posición es inversamente proporcional a la volatilidad del activo

Rendimiento en crisis(Smile Curve):

La estrategia gana dinero cuando el mercado sube mucho o cuando el mercado baja mucho.

¿Cómo se aplica esto al proyecto?

Módulo src/signals: No se necesita inventar indicadores mágicos. El paper demuestra que comparar el precio actual con el pasado (1, 3, 12 meses) es suficiente para tener una "ventaja estadística" (edge).

Módulo src/risk: El sistema debe tener "Volatility Targeting". Si no se ajusta por volatilidad, los activos locos (como Crypto) dominarán el portafolio y romperán la estrategia. El paper usa un objetivo de volatilidad del 10% anual.

El Valor Agregado (El híbrido): El paper admite que el Trend Following puede sufrir en "reversiones agudas" (cuando el mercado cambia de dirección muy rápido, como en un crash repentino).

Aquí entra el modelo IA: El modelo de FinBERT/NLP servirá para detectar esas noticias de "crash repentino" antes que la tendencia matemática, protegiendo las ganancias donde el modelo tradicional es lento.