



PORTFOLIO DE TRADING

Análisis de Resultados de Backtest

 RETORNO TOTAL

+540.82%

Return on Account

 RATIO SHARPE

1.66

Annualizado

 OPERACIONES RENTABLES

57.74%

De 6942 operaciones totales



Resultados Principales 2015-2025

Performance & Métricas Clave

Métricas de Rendimiento

Retorno Total
+540.82%

Retorno Anual
+277.77%

Factor de Beneficio
1.59

Operaciones Rentables
57.74%
4008 de 6942 trades

Ratio Sharpe Anualizado
1.66

Avg. Win / Avg. Loss
1.16

Métricas de Riesgo

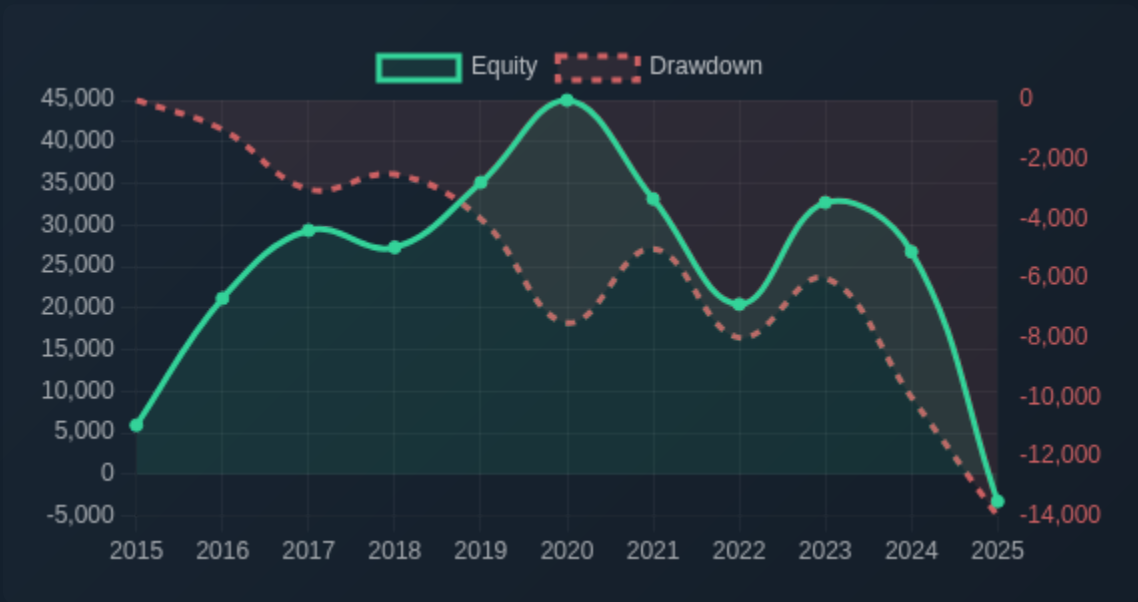
Máx. Drawdown
-35.65%

Upside Potential Ratio
62.35

Sortino Ratio
0.53

Calmar Ratio
0.00

Curva de Equity



Resumen de Rendimiento Anual

2020	2021	2022	2023	2024
+34.91%	+19.06%	+9.89%	+14.38%	+10.29%

Periodo Total: 9 Años, 10 Meses, 23 Días | Operaciones: 6942

Ganancia Bruta: \$738,054.14 | Pérdida Bruta: \$464,197.92

* Los resultados pasados no garantizan rendimientos futuros

Análisis de Rendimiento por Activo 2015-2025

Top Performers & Métricas Comparativas

Top Activos por Beneficio

Activo	Beneficio	Trades	% Rent.	Ratio
NVDA	28,871.13	301	61.46%	2.42
TSLA	22,885.35	238	60.5%	1.91
LRCX	19,652.51	429	58.51%	1.72
TTD	14,334.40	227	57.71%	1.62
PODD	14,108.06	215	63.26%	2.01
MDB	13,257.55	239	54.39%	1.43

Highlights por Categoría

Mayor Sharpe

NVDA 1.73

Mayor % Rentables

PODD 63.26%

Mayor Profit Factor

NVDA 2.42

Mayor Upside Potential

ISRG 161.58

Comparativa de Top Activos



NVDA

Top 1

Max Drawdown

-8.75%

Run-up

313.31%

TSLA

Top 2

Max Drawdown

-20.64%

Run-up

319.71%

LRCX

Top 3

Max Drawdown

-10.44%

Run-up

207.72%

Análisis de Correlación

Los datos de correlación muestran que NVDA y TSLA (0.19), así como NVDA y LRCX (0.46) mantienen bajas correlaciones en base mensual, ofreciendo buenas oportunidades de diversificación en el portfolio. La baja correlación entre activos top contribuye a la estabilidad del sistema.

💡 La combinación de los 6 activos top genera el 41.3% del beneficio total del sistema.