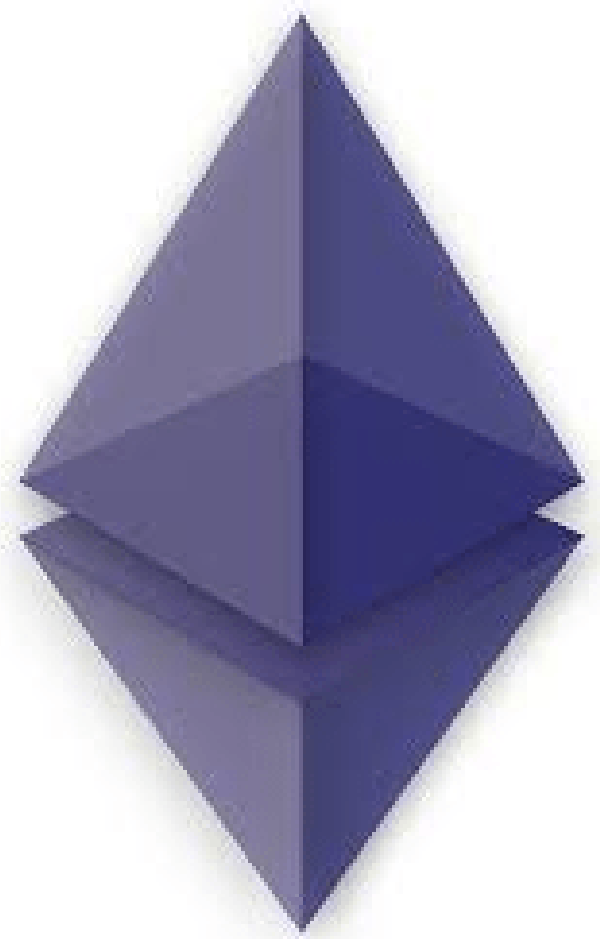


Bot de trading algorítmico

Por Antonio López-Alanís Fernández

Índice

- 03** Introducción
- 04** Obtención de datos. API.
- 05** Reglas del bot
- 06** Rentabilidad por año vs mercado
- 07** Operaciones
- 08** Rentabilidad acumulada
- 09** ¿Final?



Introducción

El objetivo de este proyecto es hacer un bot de trading algorítmico para la criptomoneda Ethereum y para un intervalo de tiempo menor a un día.

La rentabilidad tiene que ser mayor a la del mercado y el riesgo por operación debe ser fijo.



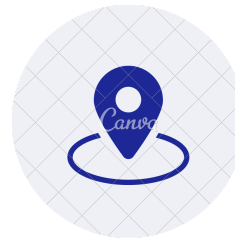
Obtención de los datos: API

Obtenemos los datos a tiempo real (actualizados cada segundo) y los datos históricos desde la API de Binance.

Ambos datos se solapan para conseguir un flujo continuo de información con suficientes velas en el pasado para usar todo tipo de indicadores.



Reglas del bot



Reglas

Medias móviles exponenciales 13, 21 y 200 con sus pendientes. RSI(14 periodos) mayor a 53 para posiciones cortas.



Timeframe

Cada vela es un periodo de 4 horas



Targets

Agresivo con posiciones largas (cruce de medias) y defensivo con las cortas (target fijo del 15%)



Riesgo y stop loss

Riesgo fijo por operación del 1,5% de la cartera.

Stop loss a 3,8% del precio de entrada.



Rentabilidad por año vs mercado

2018

- Rentabilidad del mercado: -88,31%
- Rentabilidad del bot: 168,83%
- 21 trades

2019

- Rentabilidad del mercado: 1,74%
- Rentabilidad del bot: 46,94%
- 18 trades

2020

- Rentabilidad del mercado: 470,16%
- Rentabilidad del bot: 135,75%
- 15 trades



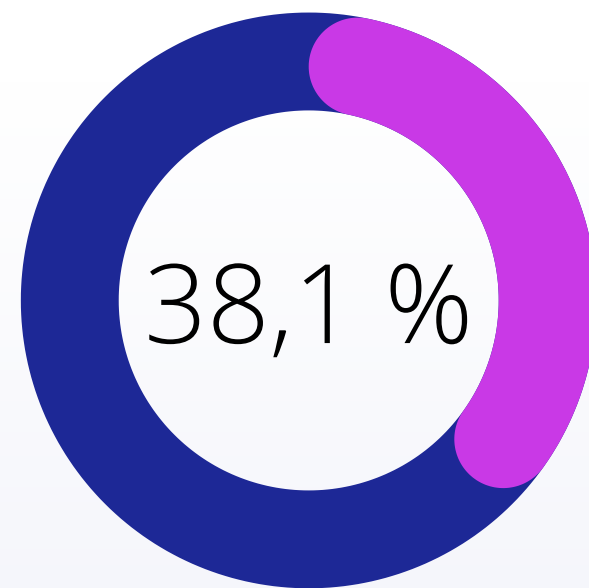
2021

- Rentabilidad del mercado: 399,2%
- Rentabilidad del bot: 1070,27%
- 17 trades

2022*

- Rentabilidad del mercado: -63,25%
- Rentabilidad del bot: 144,16%
- 26 trades

Operaciones



Win Rate

Tiempos

- Desde Diciembre de 2017, 10602 velas.
- Duración media por operación: 9 días 16 horas
- Duración máxima por operación: 138 días.

Características

- 97 operaciones en total
- Exposición al mercado: 54,83% del tiempo
- Ratio Sharpe: 1,279
- 62,89% operaciones en corto



Rentabilidad acumulada

1264,45%

Rentabilidad del mercado en el mismo periodo: 51%

Rentabilidad del mercado desde el precio mínimo (Diciembre 2018): 1586%

Rentabilidad anual: 73,17%

Mejor operación: 294,94%

Peor operación: -4%

Rentabilidad media por operación: 5,93%



FIN

**Vamos a ver la rentabilidad y operaciones
a lo largo de este bootcamp**

