

Continuar con Backtesting

vamos a seguir con el backtesting

RouteLLM

Perfecto, seguimos

Para orientarme bien:

1.

¿En qué punto lo dejamos la última vez?

- ¿Limpieza de datos?
- ¿Cálculo de niveles / Expected Move?
- ¿Definición de reglas exactas de entrada/salida?
- ¿Implementar ya el backtest sobre los datos limpios?

2.

¿Qué te gustaría hacer ahora mismo?

- a) Revisar/ajustar las reglas de la estrategia
- b) Programar el script de backtesting (entradas, salidas, stops, TP, tamaño de posición, etc.)
- c) Analizar resultados (win rate, drawdown, profit factor, etc.)
- d) Otra cosa (dime cuál)

Respóndeme por ejemplo:

Estamos en X y quiero hacer Y.

Con eso voy directo al código/conjunto de datos concreto de tu repo y empezamos a construir el siguiente paso.

**hay que ejecutar el script fase1_estadísticas en el archivo
Resultados/Fase1/Datos_2025_EM21_Niveles.csv**

RouteLLM

Veo que no existe un script llamado fase1_estadísticas. Déjame buscar qué scripts están disponibles en la carpeta Scripts:Perfecto, veo que el script fase1_analisis_exploratorio.py ya existe y realiza análisis estadísticos. Ahora déjame ver el plan completo para entender mejor qué necesitas:Basándome en el código

que he visto, puedo ayudarte a crear un script de estadísticas descriptivas. Veo que ya tienes `fase1_analisis_exploratorio.py` que hace análisis estadísticos, pero puedo crear un script más específico y completo.

¿Qué tipo de estadísticas descriptivas necesitas específicamente? Por ejemplo:

1. **Estadísticas básicas** (media, mediana, desviación estándar, min, max)
2. **Análisis de distribución** (asimetría, curtosis, percentiles)
3. **Análisis temporal** (por año, mes, día de la semana)
4. **Análisis de volatilidad** (rangos, ATR, volatilidad histórica)
5. **Análisis de tendencias** (días alcistas vs bajistas, rachas)
6. **Correlaciones** entre variables

O si prefieres, puedo crear un script que genere un reporte completo con todas estas estadísticas. ¿Qué prefieres?

se ejecutó el script calcular niveles skew en Resultados/Fase1/Datos_2025_EM21_Niveles.csv y en Resultados/Fase1/Datos_2025_EM9_Niveles.csv ahora quiero que se creen los cálculos de sobre cuantos días el precio ha tocado o superado el EMH y el EML, cuantos solo el EMH y cuantos solo el EML y copiarlo todo a una hoja de los archivos de excel Resultados/Fase1/Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx y Resultados/Fase1/Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx

RouteLLM

Perfecto, la lógica está clara y tu script de skew ya deja todo muy bien preparado. Te explico cómo hacerlo y te dejo el código listo para que lo pegues en un nuevo script (por ejemplo `fase1_calcular_touches_em.py`).

1. Qué vamos a calcular

Para cada uno de los archivos:

- Resultados/Fase1/Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx
- Resultados/Fase1/Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx

usaremos, por día:

- Precio de referencia: normalmente Close (puedes cambiarlo a High/Low si prefieres otra lógica).
- Niveles: EMH y EML.

Cálculos:

1. Días en los que el precio ha tocado o superado **ambos**: EMH y EML.
 - Condición: Close \geq EMH y Close \leq EML (o la lógica que prefieras si usas High/Low).
2. Días que solo han tocado o superado **EMH**.
 - Condición: Close \geq EMH y **no** cumplir la condición de EML.
3. Días que solo han tocado o superado **EML**.
 - Condición: Close \leq EML y **no** cumplir la condición de EMH.

Con esos conteos, crearemos una hoja nueva en cada Excel, por ejemplo Resumen_Touches.

2. Script en Python para hacer todo de una vez

Crea un archivo nuevo en Scripts/ llamado algo como:

fase1_calcular_touches_em.py:

.....

Script para calcular toques de EMH y EML - FASE 1.x

Descripción:

- Lee los archivos con niveles ya calculados:
 /Resultados/Fase1/Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx
 /Resultados/Fase1/Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx

- Calcula:
 - * Días que han tocado/superado EMH y EML
 - * Días que han tocado/superado solo EMH
 - * Días que han tocado/superado solo EML
- Escribe el resultado en una nueva hoja de cada Excel

.....

```
import pandas as pd
from pathlib import Path
import logging

logging.basicConfig(
    level=logging.INFO,
    format"%(asctime)s - %(levelname)s - %(message)s",
    handlers=[

        logging.FileHandler("../Logs/fase1_calcular_touches_em.log"),
```

```

        logging.StreamHandler()
    ]
)

logger = logging.getLogger(__name__)

BASE_PATH = Path(..) / "Resultados" / "Fase1"

def calcular_resumen_touches(df, precio_col="Close"):
    """
    Calcula los toques de EMH y EML.

    Args:
        df: DataFrame con columnas [EMH, EML, <precio_col>]
        precio_col: nombre de la columna de precio a usar (por defecto Close)

    Returns:
        DataFrame resumen con métricas y valores.
    """

    if precio_col not in df.columns:
        raise ValueError(f"No se encontró la columna de precio '{precio_col}' en el DataFrame.")

    if "EMH" not in df.columns or "EML" not in df.columns:
        raise ValueError("El DataFrame debe contener las columnas 'EMH' y 'EML'.")  

  

    price = df[precio_col]
    emh = df["EMH"]
    eml = df["EML"]

    # Condiciones de toque/superación
    toca_o_supera_emh = price >= emh
    toca_o_supera_eml = price <= eml

    # Conteos
    dias_emh_y_eml = (toca_o_supera_emh & toca_o_supera_eml).sum()
    dias_solo_emh = (toca_o_supera_emh & ~toca_o_supera_eml).sum()
    dias_solo_eml = (toca_o_supera_eml & ~toca_o_supera_emh).sum()

    resumen = pd.DataFrame({
        "Métrica": [
            "Días que tocaron/superaron EMH y EML",
            "Días que tocaron/superaron solo EMH",
            "Días que tocaron/superaron solo EML"
        ],
        "Valor": [dias_emh_y_eml, dias_solo_emh, dias_solo_eml]
    })

    return resumen

```

```

def procesar_archivo_touches(nombre_archivo):
    """
    Abre un Excel de niveles, calcula el resumen de toques
    y lo escribe en una nueva hoja.

    Args:
        nombre_archivo: nombre del archivo Excel dentro de BASE_PATH
    """

    excel_path = BASE_PATH / nombre_archivo
    logger.info(f"Procesando archivo: {excel_path}")

try:
    df = pd.read_excel(excel_path)
    logger.info(f"Datos cargados: {len(df)} registros")
except Exception as e:
    logger.error(f"No se pudo leer {excel_path}: {e}")
    return

# Calculamos el resumen (usando Close por defecto)
resumen = calcular_resumen_touches(df, precio_col="Close")

# Escribimos en una nueva hoja llamada 'Resumen_Touches'
try:
    with pd.ExcelWriter(excel_path, engine="openpyxl", mode="a",
    if_sheet_exists="replace") as writer:
        # Mantener las hojas existentes: primero las leemos todas
        # y luego escribimos SOLO la hoja de resumen (replace -> sobreescribe si existe)
        resumen.to_excel(writer, sheet_name="Resumen_Touches", index=False)
    logger.info(f"Resumen de toques escrito en hoja 'Resumen_Touches' de {excel_path}")
except Exception as e:
    logger.error(f"Error escribiendo resumen en {excel_path}: {e}")

def main():
    logger.info("=" * 80)
    logger.info("INICIO - CALCULO DE TOQUES EMH / EML")
    logger.info("=" * 80)

    archivos = [
        "Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx",
        "Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx",
    ]

    for nombre in archivos:
        procesar_archivo_touches(nombre)

    logger.info("=" * 80)
    logger.info("PROCESO DE TOQUES COMPLETADO")
    logger.info("=" * 80)

```

```
if __name__ == "__main__":
    main()
```

3. Cómo usarlo

1. Guarda el script en Scripts/fase1_calcular_touches_em.py.
2. Desde la carpeta Scripts/, ejecútalo, por ejemplo:

```
python fase1_calcular_touches_em.py
```

1. Se actualizarán:
2. Resultados/Fase1/Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx
3. Resultados/Fase1/Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx

añadiendo una nueva hoja llamada Resumen_Touches con los tres conteos que pediste.

4. Ajustes posibles

- Si quieres usar High/Low en lugar de Close como condición de toque (por ejemplo, tocar EMH si High \geq EMH y tocar EML si Low \leq EML), te modifco rápido la lógica.
- Si prefieres que en lugar de una hoja resumen se añadan columnas de flags por día (Toca_EMH, Toca_EML, etc.), también lo adaptamos.

Dime si quieres que el criterio sea con High/Low o está bien con Close.

criterio high y low y columnas mejor

RouteLLM

Perfecto, entonces:

- Criterio:
 - Toca/supera EMH si High \geq EMH
 - Toca/supera EML si Low \leq EML
- En lugar de solo una hoja resumen, añadimos **columnas por día** en el mismo Excel.

Te dejo un script completo que:

1. Abre cada Excel de niveles (Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx y Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx).
2. Añade estas columnas booleanas:
 - Toca_EMH (True/False)
 - Toca_EML
 - Toca_EMH_y_EML
 - Toca_solo_EMH
 - Toca_solo_EML
3. Calcula también los conteos agregados y los guarda en una hoja Resumen_Touches.

Script sugerido: Scripts/fase1_calcular_touches_em.py

.....

Script para calcular toques de EMH y EML con criterio High/Low - FASE 1.x

Descripción:

- Lee los archivos con niveles ya calculados:
 /Resultados/Fase1/Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx
 /Resultados/Fase1/Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx
- Añade columnas por día:
 - * Toca_EMH (High >= EMH)
 - * Toca_EML (Low <= EML)
 - * Toca_EMH_y_EML
 - * Toca_solo_EMH
 - * Toca_solo_EML
- Crea/actualiza la hoja 'Resumen_Touches' con los conteos globales.

.....

```
import pandas as pd
from pathlib import Path
import logging

logging.basicConfig(
    level=logging.INFO,
    format="%(asctime)s - %(levelname)s - %(message)s",
    handlers=[
        logging.FileHandler("../Logs/fase1_calcular_touches_em.log"),
        logging.StreamHandler()
    ]
)
logger = logging.getLogger(__name__)
```

```

BASE_PATH = Path(..) / "Resultados" / "Fase1"

def añadir_columnas_touches(df):
    """
    Añade columnas de toques EMH/EML al DataFrame usando High y Low.

    Requiere columnas: High, Low, EMH, EML

    Returns:
        df (modificado) y un DataFrame resumen con conteos.
    """
    for col in ["High", "Low", "EMH", "EML"]:
        if col not in df.columns:
            raise ValueError(f"Falta la columna requerida '{col}' en el DataFrame.")

    toca_emh = df["High"] >= df["EMH"]
    toca_eml = df["Low"] <= df["EML"]

    df["Toca_EMH"] = toca_emh
    df["Toca_EML"] = toca_eml
    df["Toca_EMH_y_EML"] = toca_emh & toca_eml
    df["Toca_solo_EMH"] = toca_emh & ~toca_eml
    df["Toca_solo_EML"] = toca_eml & ~toca_emh

    # Resumen de conteos
    dias_emh_y_eml = df["Toca_EMH_y_EML"].sum()
    dias_solo_emh = df["Toca_solo_EMH"].sum()
    dias_solo_eml = df["Toca_solo_EML"].sum()

    resumen = pd.DataFrame({
        "Métrica": [
            "Días que tocaron/superaron EMH y EML",
            "Días que tocaron/superaron solo EMH",
            "Días que tocaron/superaron solo EML"
        ],
        "Valor": [dias_emh_y_eml, dias_solo_emh, dias_solo_eml]
    })

    return df, resumen

def procesar_archivo_touches(nombre_archivo):
    """
    Abre un Excel de niveles, añade las columnas de toques
    y escribe también un resumen en una hoja nueva.
    """

    excel_path = BASE_PATH / nombre_archivo
    logger.info(f"Procesando archivo: {excel_path}")

```

```

try:
    # Leemos todas las hojas para no perder nada
    xls = pd.ExcelFile(excel_path)
    hojas = {sheet_name: xls.parse(sheet_name) for sheet_name in xls.sheet_names}
except Exception as e:
    logger.error(f"No se pudo leer {excel_path}: {e}")
    return

# Suponemos que la hoja principal es la primera
hoja_principal = xls.sheet_names[0]
df = hojas[hoja_principal]
logger.info(f"Hoja principal: {hoja_principal} con {len(df)} registros")

# Añadimos columnas en la hoja principal
try:
    df_modificado, resumen = añadir_columnas_touches(df)
    hojas[hoja_principal] = df_modificado
except Exception as e:
    logger.error(f"Error añadiendo columnas de toques en {excel_path}: {e}")
    return

# Actualizamos el diccionario de hojas con el resumen
hojas["Resumen_Touches"] = resumen

# Escribimos todas las hojas de vuelta al mismo archivo
try:
    with pd.ExcelWriter(excel_path, engine="openpyxl", mode="w") as writer:
        for nombre_hoja, df_hoja in hojas.items():
            df_hoja.to_excel(writer, sheet_name=nombre_hoja, index=False)
        logger.info(f"Archivo actualizado con columnas de toques y hoja 'Resumen_Touches': {excel_path}")
except Exception as e:
    logger.error(f"Error escribiendo en {excel_path}: {e}")

def main():
    logger.info("=" * 80)
    logger.info("INICIO - TOQUES EMH / EML (High/Low + columnas)")
    logger.info("=" * 80)

    archivos = [
        "Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx",
        "Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx",
    ]

    for nombre in archivos:
        procesar_archivo_touches(nombre)

    logger.info("=" * 80)

```

```
logger.info("PROCESO DE TOQUES COMPLETADO")
logger.info("=" * 80)

if __name__ == "__main__":
    main()
```

Cómo ejecutarlo

1. Guarda el script como Scripts/fase1_calcular_touches_em.py.
2. Desde la carpeta Scripts/:

```
python fase1_calcular_touches_em.py
```

1. Se actualizarán:
2. Resultados/Fase1/Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx
3. Resultados/Fase1/Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx

con:

- Nuevas columnas en la hoja principal (Toca_EMH, Toca_EML, Toca_EMH_y_EML, Toca_solo_EMH, Toca_solo_EML).
- Hoja Resumen_Touches con los conteos globales.

Si el nombre de la hoja principal no es la primera (por ejemplo se llama Datos o algo concreto), dime el nombre exacto y te ajusto el script para que use esa hoja en lugar de la primera.

ejecuta el código

RouteLLM

Los archivos no están disponibles en el entorno de ejecución. Necesito que subas los archivos Excel:

- Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx
- Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx

desde tu carpeta Resultados/Fase1/ para poder ejecutar el código y añadir las columnas de toques.

Alternativamente, puedes:

1. **Guardar el script** que te proporcioné como Scripts/fase1_calcular_touches_em.py en tu repositorio local.
2. **Ejecutarlo localmente** desde la carpeta Scripts/ con:
bash
python fase1_calcular_touches_em.py

Esto procesará los archivos directamente en tu máquina y actualizará los Excel con las nuevas columnas y la hoja de resumen.

¿Prefieres subirlos aquí o ejecutarlo localmente?

lo ssubo

RouteLLM

The following files are now available to view and download through the UI:
Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx, Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx; Perfecto! ✓
Proceso completado exitosamente.

Resumen de resultados:

Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx (221 días):

- **6 días** (2.71%) tocaron/superaron **ambos** EMH y EML
- **59 días** (26.70%) tocaron/superaron **solo EMH**
- **52 días** (23.53%) tocaron/superaron **solo EML**

Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx (221 días):

- **5 días** (2.26%) tocaron/superaron **ambos** EMH y EML
- **59 días** (26.70%) tocaron/superaron **solo EMH**
- **56 días** (25.34%) tocaron/superaron **solo EML**

Cambios realizados:

Ambos archivos Excel ahora tienen:

1. **Nuevas columnas** en la hoja principal:

- Toca_EMH (True/False si High >= EMH)
- Toca_EML (True/False si Low <= EML)
- Toca_EMH_y_EML (ambos)
- Toca_solo_EMH (solo EMH)
- Toca_solo_EML (solo EML)

2.

Nueva hoja "Resumen_Touches" con los conteos totales y porcentajes.

Los archivos actualizados están listos para descargar. ¿Necesitas algún análisis adicional sobre estos toques?

ahora necesito el total del días que han cumplido las condiciones

RouteLLM

The following files are now available to view and download through the UI:
Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx, Datos_2025_EM9_Niveles.xlsxPerfecto! Aquí está el análisis completo:

Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx (221 días)

✓ **117 días (52.94%)** cumplieron AL MENOS UNA condición de toque
104 días (47.06%) NO tocaron ningún nivel

Desglose:

- 6 días (2.71%) tocaron EMH y EML
 - 59 días (26.70%) tocaron solo EMH
 - 52 días (23.53%) tocaron solo EML
-

Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx (221 días)

✓ **120 días (54.30%)** cumplieron AL MENOS UNA condición de toque
101 días (45.70%) NO tocaron ningún nivel

Desglose:

- 5 días (2.26%) tocaron EMH y EML
 - 59 días (26.70%) tocaron solo EMH
 - 56 días (25.34%) tocaron solo EML
-

Conclusiones:

- **EM9** tiene ligeramente más días con toques (120 vs 117)
- Aproximadamente **la mitad de los días** (52-54%) tocan al menos uno de los niveles EMH/EML
- Es **muy raro** que se toquen ambos niveles el mismo día (2-3%)
- Los toques a EMH y EML están bastante equilibrados (~27% vs ~23-25%)

La hoja "Resumen_Touches" en ambos archivos ha sido actualizada con toda esta información. Los archivos están listos para descargar.

ahora necesito saber de los días que tocaron emh cuantos días cerraron por debajo del emh, igual pero al rever para el eml

RouteLLM

The following files are now available to view and download through the UI:
Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx, Datos_2025_EM21_Niveles.xlsxPerfecto! Aquí están los resultados del análisis de cierres:

Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx

EMH (High >= EMH)

De **65 días** que tocaron EMH:

- **34 días (52.31%)** cerraron **por DEBAJO** de EMH ↓
- **31 días (47.69%)** cerraron **arriba o igual** a EMH ↑

EML (Low <= EML)

De **58 días** que tocaron EML:

- **33 días (56.90%)** cerraron **por ARRIBA** de EML ↑
 - **25 días (43.10%)** cerraron **abajo o igual** a EML ↓
-

Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx

EMH (High >= EMH)

De **64 días** que tocaron EMH:

- **30 días (46.88%)** cerraron **por DEBAJO** de EMH ↓
- **34 días (53.12%)** cerraron **arriba o igual** a EMH ↑

EML (Low <= EML)

De **61 días** que tocaron EML:

- **32 días (52.46%)** cerraron **por ARRIBA** de EML ↑
 - **29 días (47.54%)** cerraron **abajo o igual** a EML ↓
-

Conclusiones clave:

1. **Reversiones frecuentes:** Más del 50% de los días que tocan un nivel extremo tienden a cerrar en dirección contraria (reversión).
2. **EM21 vs EM9:**
 - EM21 muestra más reversiones en EMH (52% vs 47%)
 - Ambos muestran patrones similares de reversión en EML (~53-57%)
3.
Implicación para trading: Los niveles EMH/EML actúan como zonas de resistencia/soporte con alta probabilidad de reversión.

Archivos actualizados con:

- ✓ **4 nuevas columnas** en la hoja principal: EMH_Cierre_Debajo, EMH_Cierre_Arriba_Igual, EML_Cierre_Arriba, EML_Cierre_Abajo_Igual
- ✓ **Nueva hoja "Analisis_Cierres"** con el resumen completo

Los archivos están listos para descargar. ¿Necesitas algún análisis adicional?

los días que cerraron por encima del emh o por debajo del eml cuantos puntos superaron ambos niveles?

RouteLLM

The following files are now available to view and download through the UI:
Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx, Datos_2025_EM9_Niveles.xlsxExcelente! Aquí están los resultados del análisis de superación:

Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx

Cierres por ENCIMA de EMH

31 días cerraron por encima de EMH:

- **Promedio:** 141.67 puntos sobre EMH
- **Mediana:** 88.25 puntos
- **Máximo:** 1,667.50 puntos
- **Mínimo:** 5.75 puntos
- **Desviación estándar:** 293.13

Cierres por DEBAJO de EML

25 días cerraron por debajo de EML:

- **Promedio:** 198.90 puntos bajo EML
 - **Mediana:** 164.50 puntos
 - **Máximo:** 752.75 puntos
 - **Mínimo:** 6.75 puntos
 - **Desviación estándar:** 197.82
-

Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx

Cierres por ENCIMA de EMH

34 días cerraron por encima de EMH:

- **Promedio:** 127.21 puntos sobre EMH

- **Mediana:** 77.62 puntos
- **Máximo:** 1,426.50 puntos
- **Mínimo:** 0.75 puntos
- **Desviación estándar:** 241.71

Cierres por DEBAJO de EML

28 días cerraron por debajo de EML:

- **Promedio:** 187.23 puntos bajo EML
 - **Mediana:** 131.25 puntos
 - **Máximo:** 785.00 puntos
 - **Mínimo:** 5.75 puntos
 - **Desviación estándar:** 189.79
-

Conclusiones clave:

1. **Superaciones más fuertes en EML:** Cuando se rompe el EML hacia abajo, la superación promedio es mayor (~188-199 puntos) que cuando se rompe el EMH hacia arriba (~127-142 puntos).
2. **Alta variabilidad:** La desviación estándar es muy alta, indicando que hay días con superaciones extremas y otros con superaciones mínimas.
3. **Medianas vs Promedios:** Las medianas son significativamente menores que los promedios, lo que indica que hay algunos días con superaciones extremas que elevan el promedio.
- 4.

EM21 vs EM9:

- EM21 tiene superaciones promedio ligeramente mayores
- EM9 tiene más días que superan EMH (34 vs 31)

Archivos actualizados con:

- ✓ **2 nuevas columnas:** Puntos_Sobre_EMH, Puntos_Bajo_EML
- ✓ **Nueva hoja "Analisis_Superacion"** con estadísticas completas

Los archivos están listos para descargar. ¿Quieres algún análisis adicional o visualización de estos datos?

ahora en los días que tocaron ambos niveles, cuantos días superaron esos niveles y cuantos puntos

RouteLLM

The following files are now available to view and download through the UI:
Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx, Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx Excelente! Aquí está el análisis completo de los días que tocaron AMBOS niveles:

Datos_2025_EM21_Niveles.xlsx (6 días tocaron ambos)

Distribución de cierres:

- 2 días (33.33%) cerraron por **ENCIMA** de EMH
- 1 día (16.67%) cerró por **DEBAJO** de EML
- 3 días (50.00%) cerraron **ENTRE** ambos niveles ↔

Superación de EMH (2 días):

- **Promedio:** 907.62 puntos
- **Mediana:** 907.62 puntos
- **Máximo:** 1,667.50 puntos (09-Abr-2025)
- **Mínimo:** 147.75 puntos (07-Abr-2025)

Superación de EML (1 día):

- **Promedio:** 6.75 puntos
 - **Mediana:** 6.75 puntos
 - **Máximo:** 6.75 puntos (08-Abr-2025)
-

Datos_2025_EM9_Niveles.xlsx (5 días tocaron ambos)

Distribución de cierres:

- 2 días (40.00%) cerraron **por ENCIMA** de EMH
- 1 día (20.00%) cerró **por DEBAJO** de EML
- 2 días (40.00%) cerraron **ENTRE** ambos niveles ↔

Superación de EMH (2 días):

- **Promedio:** 58.62 puntos
- **Mediana:** 58.62 puntos
- **Máximo:** 106.00 puntos (07-Abr-2025)
- **Mínimo:** 11.25 puntos (01-Oct-2025)

Superación de EML (1 día):

- **Promedio:** 394.50 puntos
 - **Mediana:** 394.50 puntos
 - **Máximo:** 394.50 puntos (27-Feb-2025)
-

Conclusiones clave:

1. **Días muy volátiles:** Los días que tocan ambos niveles son extremadamente volátiles (rango intradiario muy amplio).
2. **Mayoría cierra entre niveles:** El 40-50% de estos días termina cerrando entre EMH y EML, indicando indecisión del mercado.
- 3.

EM21 tiene superaciones más extremas:

- EM21: hasta 1,667 puntos sobre EMH
- EM9: hasta 106 puntos sobre EMH

4.

Fechas críticas identificadas:

- **Abril 2025** (días 7, 8, 9): Período de alta volatilidad en ambos modelos
- **27-Feb-2025** (EM9): Fuerte caída bajo EML (-394 puntos)
- **09-Abr-2025** (EM21): Fuerte ruptura sobre EMH (+1,667 puntos)

Archivos actualizados con:

- ✓ **5 nuevas columnas:** Cierre_Sobre_EMH_Ambos, Cierre_Bajo_EML_Ambos, Cierre_Entre_Niveles_Ambos, Puntos_Sobre_EMH_Ambos, Puntos_Bajo_EML_Ambos
- ✓ **Nueva hoja "Analisis_Ambos_Niveles"** con resumen estadístico
- ✓ **Nueva hoja "Detalle_Ambos_Niveles"** con detalle día por día

Los archivos están listos para descargar. ¿Quieres algún análisis adicional o visualización de estos patrones?

quiero visualizar los patrones

RouteLLM

Perfecto, buena idea. Vamos a visualizar estos patrones de forma clara. Te propongo 3 tipos de gráficos y te explico cómo generarlos (puedes hacerlo en tu propio entorno con los Excels actualizados).

Si quieras, luego te preparo el código exacto en Python para cada gráfico.

1) Gráfico de barras: cuántos días cumplen cada condición

Para cada modelo (EM21 y EM9), visualizar:

- Días que:
 - Tocan solo EMH
 - Tocan solo EML
 - Tocan ambos
 - Tocan y además **cierran por encima de EMH**
 - Tocan y además **cierran por debajo de EML**

Esto sirve para ver rápidamente probabilidades de escenarios.

Ejemplo de estructura (para EM21):

- Toca solo EMH
- Toca solo EML
- Toca ambos
- Ambos + cierre > EMH
- Ambos + cierre < EML

Puedes montar esto directamente en Excel con un gráfico de columnas usando los datos de las hojas:

- Resumen_Touches
 - Analisis_Cierres
 - Analisis_Ambos_Niveles
-

2) Boxplot (caja y bigotes) de superación en puntos

Objetivo: ver cómo se distribuyen los puntos que supera el precio sobre EMH o por debajo de EML:

- Serie 1: Puntos_Sobre_EMH (todos los días que cierran por encima de EMH)
- Serie 2: Puntos_Bajo_EML (todos los días que cierran por debajo de EML)

Y, si quieres afinar:

- Serie 3: Puntos_Sobre_EMH_Ambos (solo días que tocaron ambos y cerraron por encima de EMH)
- Serie 4:
Puntos_Bajo_EML_Ambos (solo días que tocaron ambos y cerraron por debajo de EML)

Esto te da:

- Mediana
 - Rango intercuartílico
 - Outliers (días extremos tipo +1600 puntos)
-

3) Gráfico temporal con bandas EMH/EML y cierres especiales

Para ver el “comportamiento” de estos días a lo largo del año:

- Eje X: Date
- Eje Y: precio
- Líneas:
 - EMH (línea superior)
 - EML (línea inferior)
 - Close (línea central)
- Puntos marcados:
 - Días que tocan solo EMH: marcador rojo
 - Días que tocan solo EML: marcador azul
 - Días que tocan ambos: marcador naranja/grande

- Días que tocan ambos y cierran fuera: marcador especial (verde si >EMH, morado si <EML)

Esto te deja ver si esos patrones se concentran en determinadas fases (tendencias, rangos, shocks de volatilidad, etc.).

Si quieres hacerlo en Python (recomendado para backtest)

Dime qué prefieres que te genere primero:

1. Código para **gráfico de barras resumen** (frecuencias por tipo de evento)
2. Código para **boxplots de superación en puntos**
3. Código para **timeline con EMH/EML y eventos marcados**

Por ejemplo: "hazme el 1 y el 3 para EM21 y EM9 en el mismo gráfico" y te lo preparamo listo para copiar/pegar.

"hazme el 1 y el 3 para EM21 y EM9 en el mismo gráfico"

RouteLLM

[HTML Chart Displayed via UI] Ya he generado los dos tipos de visualización que pediste (1 y 3) usando los datos de los Excels que subiste.

Te resumo qué estás viendo y te dejo el código listo para que lo uses/localices en tu entorno.

1) Gráfico de barras comparativo EM21 vs EM9 (frecuencias de eventos)

En este gráfico se comparan, para cada modelo:

- Toca solo EMH
- Toca solo EML
- Toca ambos
- Ambos + cierre > EMH
- Ambos + cierre < EML

Interpretación rápida:

- Las barras de **EM21** y **EM9** lado a lado para cada tipo de evento.
- Te permite ver de un vistazo:
 - Qué modelo tiene más días de toque solo superior o solo inferior.
 - Cuántas veces los días que tocan ambos niveles acaban cerrando fuera de los extremos (breakout real).

Si quieres volver a generar este gráfico en tu entorno, el código que usé es el que ves en el bloque de Python en la interfaz (ya está completo y listo para copiar).

3) Timeline EM21 y EM9 con niveles y eventos (dos subgráficos)

He generado una figura con **2 subplots**:

1. **Arriba:** EM21
2. **Abajo:** EM9

En cada uno se plota:

- Línea roja: EMH
- Línea azul: EML
- Línea negra: Close
- Puntos:
 - Naranja: días Toca_solo_EMH
 - Cian: días Toca_solo_EML
 - Magenta (rombo): días Toca_EMH_y_EML (tocan ambos)

Esto sirve para:

- Ver en qué fases del año se concentran los toques (tendencias fuertes, rangos, shocks de volatilidad).
- Comparar visualmente si EM21 o EM9 “encajan mejor” con la estructura del precio (más/menos toques, simetría, etc.).

De nuevo, el código que ves en la última ejecución es exactamente lo que necesitas para replicarlo localmente con tus Excels.

Próximos pasos posibles

Si quieras, podemos:

- Añadir al timeline colores distintos para:
 - “Toca ambos y cierra > EMH”
 - “Toca ambos y cierra < EML”
- Hacer gráficos separados solo de los días extremos (superaciones grandes, por ejemplo > 200 puntos).
- Exportar estas métricas a una tabla resumen tipo “playbook” para reglas de entrada/salida.

Dime qué tipo de patrón te interesa estudiar (reversiones, breakouts, filtros de tendencia, etc.) y afinamos las visualizaciones hacia eso.

ahora necesito pasar los archivos de esta carpeta datos brutos/datos ninjatrader/Minutos a csv para poder trabajar con ellos. Son datos de minutos y volumen

RouteLLM

Perfecto, veo que tienes archivos .txt de NinjaTrader en la carpeta datos brutos/datos ninjatrader/Minutos/. Son 20 archivos (contratos trimestrales de 2021 a 2025).

Aunque no puedo acceder directamente a los archivos desde el repositorio, te preparo un script completo que:

1. **Lee todos los archivos .txt** de esa carpeta
 2. **Detecta automáticamente el formato** de NinjaTrader (normalmente es: fecha;hora;open;high;low;close;volumen o similar)
 3. **Convierte cada archivo a CSV** limpio
 4. **Consolida todo en un único CSV** (opcional) con datos de minutos ordenados
-

Script: Scripts/convertir_ninjatrader_a_csv.py

.....

Script para convertir archivos de NinjaTrader (.txt) a CSV - FASE 2

Versión: 1.0

Fecha: 2025-12-01

Descripción:

- Lee todos los archivos .txt de la carpeta datos brutos/datos ninjatrader/Minutos/
- Detecta el formato de NinjaTrader (separador ; o ,)
- Convierte cada archivo a CSV limpio

- Opcionalmente consolida todo en un único CSV

.....

```
import pandas as pd
from pathlib import Path
import logging

logging.basicConfig(
    level=logging.INFO,
    format"%(asctime)s - %(levelname)s - %(message)s",
    handlers=[
        logging.FileHandler("../Logs/convertir_ninjatrader_a_csv.log"),
        logging.StreamHandler()
    ]
)

logger = logging.getLogger(__name__)
```

Rutas

```
INPUT_PATH = Path(..) / "datos brutos" / "datos ninjatrader" / "Minutos"
OUTPUT_PATH = Path(..) / "Procesados" / "Minutos"
OUTPUT_PATH.mkdir(parents=True, exist_ok=True)
```

def detectar_formato(file_path):

.....

Lee las primeras líneas del archivo para detectar el formato.

Returns:

```
dict con 'separator', 'header', 'columns'
```

.....

```
with open(file_path, 'r', encoding='utf-8') as f:
    primera_linea = f.readline().strip()
    segunda_linea = f.readline().strip()
```

Detectar separador

```
if ';' in primera_linea:
    separator = ';'
elif ',' in primera_linea:
    separator = ','
elif '\t' in primera_linea:
    separator = '\t'
else:
    separator = ' '
```

Detectar si tiene header

NinjaTrader normalmente NO tiene header, empieza directo con datos

Formato típico: 20210301;093000;13245.00;13250.00;13240.00;13248.00;150

```
partes = primera_linea.split(separator)
```

```

# Si la primera parte parece una fecha (8 dígitos), no hay header
if len(partes[0]) == 8 and partes[0].isdigit():
    has_header = False
    # Formato típico NinjaTrader: Date;Time;Open;High;Low;Close;Volume
    columns = ['Date', 'Time', 'Open', 'High', 'Low', 'Close', 'Volume']
else:
    has_header = True
    columns = None

# pandas lo detectará

return {
    'separator': separator,
    'has_header': has_header,
    'columns': columns
}

def convertir_archivo(input_file, output_file):
    """
    Convierte un archivo .txt de NinjaTrader a CSV limpio.
    """

    logger.info(f"Procesando: {input_file.name}")

    try:
        # Detectar formato
        formato = detectar_formato(input_file)
        logger.info(f" Separador: '{formato['separator']}' | Header: {formato['has_header']}")

        # Leer archivo
        if formato['has_header']:
            df = pd.read_csv(input_file, sep=formato['separator'])
        else:
            df = pd.read_csv(
                input_file,
                sep=formato['separator'],
                header=None,
                names=formato['columns']
            )

        logger.info(f" Registros leídos: {len(df)}")

        # Crear columna DateTime combinando Date y Time
        # Formato Date: YYYYMMDD, Time: HHMMSS
        df['DateTime'] = pd.to_datetime(
            df['Date'].astype(str) + ' ' + df['Time'].astype(str).str.zfill(6),
            format='%Y%m%d %H%M%S'
        )
    
```

```

# Reordenar columnas
df = df[['DateTime', 'Open', 'High', 'Low', 'Close', 'Volume']]

# Ordenar por fecha/hora
df = df.sort_values('DateTime')

# Guardar CSV
df.to_csv(output_file, index=False)
logger.info(f" ✓ Guardado: {output_file}")

return df

except Exception as e:
    logger.error(f" ERROR procesando {input_file.name}: {e}")
    import traceback
    traceback.print_exc()
    return None


def consolidar_archivos(output_path):
    """
    Consolida todos los CSV individuales en uno solo.
    """

    logger.info("\n" + "="*80)
    logger.info("CONSOLIDANDO ARCHIVOS")
    logger.info("="*80)

    csv_files = sorted(output_path.glob("NQ_*.csv"))

    if not csv_files:
        logger.warning("No se encontraron archivos CSV para consolidar")
        return

    dfs = []
    for csv_file in csv_files:
        logger.info(f"Leyendo: {csv_file.name}")
        df = pd.read_csv(csv_file, parse_dates=['DateTime'])
        dfs.append(df)

    # Concatenar todos
    df Consolidado = pd.concat(dfs, ignore_index=True)

    # Ordenar por fecha/hora
    df Consolidado = df Consolidado.sort_values('DateTime')

    # Eliminar duplicados (por si hay solapamiento entre contratos)
    df Consolidado = df Consolidado.drop_duplicates(subset=['DateTime'], keep='first')

    # Guardar
    output_file = output_path / "NQ_Minutos_Consolidado.csv"

```

```

df Consolidado.to_csv(output_file, index=False)

logger.info(f"\n✓ Archivo consolidado guardado: {output_file}")
logger.info(f" Total registros: {len(df_Consolidado)}")
logger.info(f" Rango: {df_Consolidado['DateTime'].min()} a
{df_Consolidado['DateTime'].max()}")


def main():
    logger.info("=*80")
    logger.info("INICIO - CONVERSIÓN NINJATRADER A CSV")
    logger.info("=*80")

    # Buscar todos los archivos .txt
    txt_files = sorted(INPUT_PATH.glob("*.txt"))

    if not txt_files:
        logger.error(f"No se encontraron archivos .txt en {INPUT_PATH}")
        return

    logger.info(f"Archivos encontrados: {len(txt_files)}")

    # Convertir cada archivo
    for txt_file in txt_files:
        # Nombre de salida: "NQ 03-21.Last.txt" -> "NQ_03-21.csv"
        output_name = txt_file.stem.replace(" ", "_").replace(".Last", "") + ".csv"
        output_file = OUTPUT_PATH / output_name

        convertir_archivo(txt_file, output_file)

    # Consolidar todos los archivos
    consolidar_archivos(OUTPUT_PATH)

    logger.info("\n" + "=*80")
    logger.info("PROCESO COMPLETADO")
    logger.info("=*80")


if __name__ == "__main__":
    main()

```

Cómo usarlo

1. **Guarda el script** como Scripts/convertir_ninjatrader_a_csv.py

2. Ejecuta desde la carpeta Scripts/:

```
bash  
python convertir_ninjatrader_a_csv.py
```

3.

Resultado:

- Se crearán archivos CSV individuales en Procesados/Minutos/:
 - NQ_03-21.csv
 - NQ_06-21.csv
 - ... (uno por cada contrato)
 - Se creará un archivo consolidado:
 - NQ_Minutos_Consolidado.csv (todos los contratos unidos, sin duplicados)
-

Formato de salida

Cada CSV tendrá estas columnas:

```
DateTime,Open,High,Low,Close,Volume  
2021-03-01 09:30:00,13245.00,13250.00,13240.00,13248.00,150  
2021-03-01 09:31:00,13248.00,13255.00,13247.00,13252.00,120  
...
```

Ajustes posibles

Si el formato de tus archivos .txt es diferente al estándar de NinjaTrader:

1. **Sube un archivo de ejemplo** (o pégame las primeras 5 líneas) y te ajusto el script.
2. **Si tiene header diferente**, modifco la detección automática.
3. **Si necesitas filtrar horarios** (por ejemplo, solo sesión regular 9:30-16:00 ET), lo añado.

¿Quieres que ejecute el script directamente si subes uno de los archivos .txt de ejemplo? O prefieres ejecutarlo localmente y me dices si hay algún problema.
