



**Guía de estadísticas
trading cuantitativo:**

Porcentaje de aciertos: Te ayuda a identificar qué porcentaje de aciertos tiene la estrategia y si tiene un RR de 1:1 o mayor.

Profit Factor: Relación entre las ganancias brutas y las pérdidas brutas. Mide la eficiencia del sistema. Cuanto mayor, más rentable en relación al riesgo asumido.

Una estrategia es rentable si su profit factor es mayor a 1. Una estrategia se considera buena a partir de 1.3.

Valor esperado: Promedio de ganancia/pérdida por operación. Mide cuánto se espera ganar o perder por cada trade. Muy útil para evaluar el riesgo/recompensa general. Una estrategia es rentable si es mayor que 0.

Drawdown máximo: Es la caída máxima del capital desde un pico a un valle antes de una nueva subida.

Sharpe Ratio: Mide la rentabilidad ajustada por volatilidad (riesgo). Ayuda a entender si la rentabilidad compensa el riesgo asumido.

Lo ideal es que una estrategia tenga un Sharpe Ratio mayor a 1 en el periodo anual, y mayor a 0.3 en el periodo mensual.

Calmar Ratio: Relación entre rentabilidad anual y drawdown máximo. Sirve para evaluar el riesgo-rendimiento a largo plazo.

Lo ideal es que esté por encima de 1 o 2.

Recovery Factor: Cuánto beneficio total se ha generado en relación al máximo drawdown absoluto. Mide la capacidad del sistema para recuperarse de pérdidas grandes.

Lo ideal es que esté por encima de 1 o 2.