

REPORTE INSTITUCIONAL DE VALIDACIÓN

Run cuenta live

Reporte ejecutivo y técnico de validación del sistema. Construido sobre información consolidada del broker, con foco en retorno, control de riesgo y trazabilidad operativa. Trading algorítmico automatizado · estrategia de reversión a la media.

PERÍODO · 2025-01-01 → 2026-06-13

ESTRATEGIA · MEAN REVERSION

FUENTE · BROKER + OUTPUT VALIDADO

RETORNO TOTAL

+274.68%

Capital 10.000 → 37.468 USD

PROFIT FACTOR

4.41

Ganancia bruta / pérdida bruta

MÁX. DRAWDOWN

16.60%

Riesgo contenido · monitoreo

Uso: documento de apoyo para presentación a inversores y revisión interna de robustez del sistema. **Importante:** los rendimientos pasados no garantizan resultados futuros. Invertir implica riesgo de pérdida de capital.

OPERACIONES

47

Ejecución sistemática

WIN RATE

72.34%

34 ganadoras / 13 perdedoras

PNL NETO (USD)

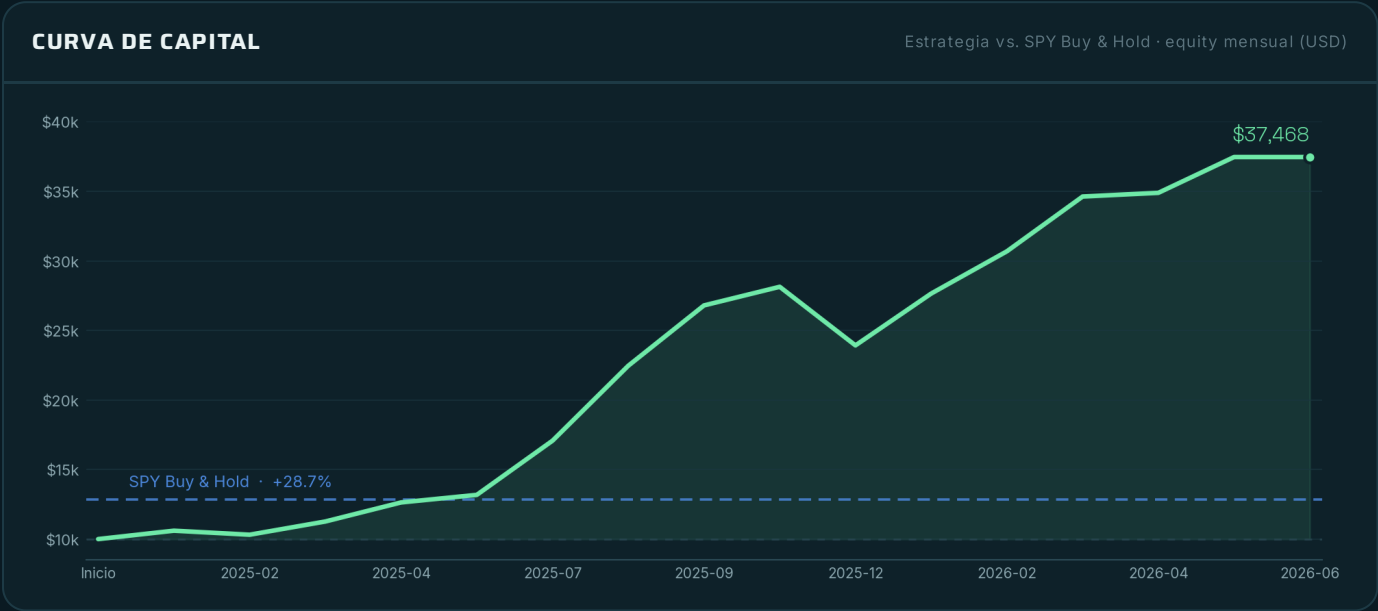
+27.467,65

Resultado consolidado

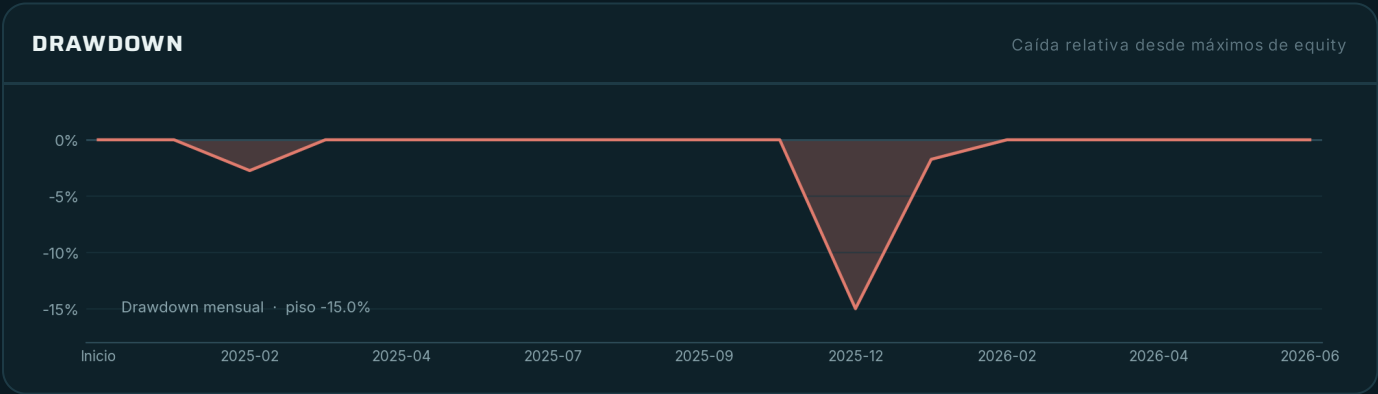
RETORNO TOTAL

+274.68%

Sobre capital inicial



CAPITAL INICIAL	CAPITAL FINAL	MEJOR TRADE	PEOR TRADE	HOLD MÁXIMO
10.000,00	37.467,65	+4.065,78	-2.438,73	3 días



Fuente: información consolidada del broker y salidas de /outputs/20260613_233414_backtest_mean_reversion. El drawdown mensual toca un piso de -15.0%; el máximo drawdown a nivel de operación registrado es 16.60%.

APERTURA DE POSICIONES

Las aperturas se ejecutan solo cuando el filtro de contexto valida ventaja estadística.

- Confirmación de set-up por condición de reversión.
- Dimensionamiento por control de exposición y riesgo de cartera.
- Ejecución sistemática, sin intervención discrecional.
- Universo operado: SPY, QQQ, TLT, XLP, SOXL.

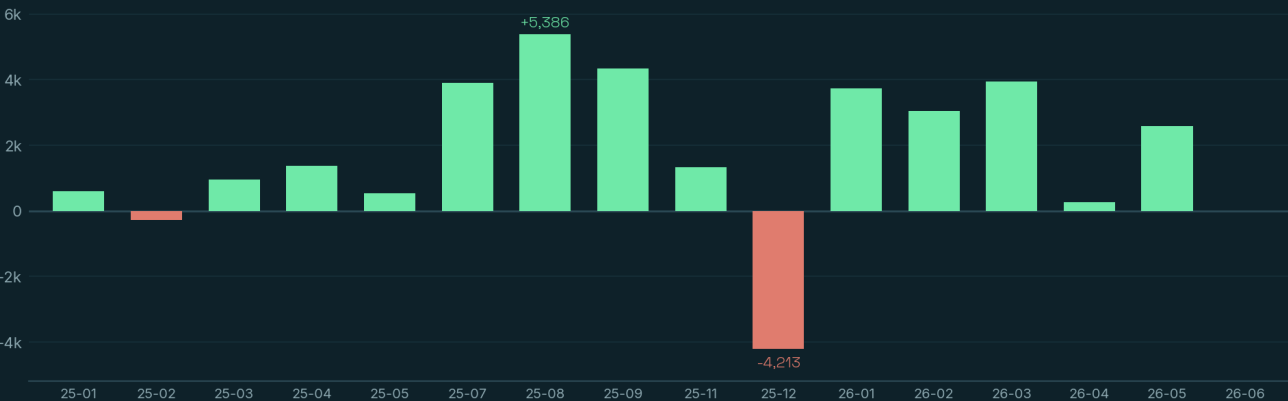
CIERRE DE POSICIONES

Los cierres responden a reglas objetivas y protección activa del capital.

- Cierres por reversión: 45.
- Cierres por stop loss: 2.
- Hold máximo observado: 3 días.
- Sin uso de fechas ni precios puntuales en esta sección.

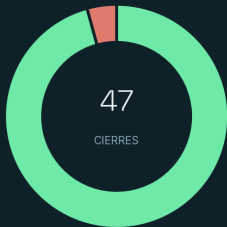
RENDIMIENTO MENSUAL

Ganancia Pérdida



UNIVERSO MONITOREADO VS. EJECUTADO 11 monitoreados · 5 con trades

CATEGORÍA	CANT.	TICKERS
Universo monitoreado	11	GLD, QCLN, QQQ, SOXL, SPY, TAN, TECL, TLT, TQQQ, XLP, XLV
Ejecutado (con trades)	5	QQQ, SOXL, SPY, TLT, XLP
Monitoreado sin ejecución	6	GLD, QCLN, TAN, TECL, TQQQ, XLV



Reversión 95.74% Stop loss 4.26%

El sistema monitorea un universo más amplio, pero solo abre posiciones cuando las reglas de entrada confirman ventaja estadística.

INDICADORES DE VALIDACIÓN · ESTÁNDAR DE MERCADO			Run cuenta live
INDICADOR	VALOR	LECTURA	
Profit Factor	4.41	Ganancias brutas superan ampliamente las pérdidas brutas.	
Expectancy por operación	+584,42	Esperanza matemática positiva por trade (USD).	
Relación Ganancia/Pérdida	1.69*	Ganancia media > pérdida media por operación.	
Máximo Drawdown	16.60%	Riesgo contenido para el retorno acumulado observado.	
CAGR	152.89%	Crecimiento anual compuesto elevado para la ventana.	
Calmar Ratio	9.21	Retorno ajustado por drawdown en rango robusto.	
Sharpe Ratio	3.09	Buen retorno ajustado por volatilidad.	
Sortino Ratio	4.13	Penalización por riesgo bajista favorable.	
Win Rate	72.34%	Frecuencia ganadora consistente.	
Total Return	+274.68%	Expresión agregada del desempeño del período.	

SEMÁFORO DE RIESGO			Por indicador
INDICADOR	VALOR	ESTADO	
Profit Factor	4.41		VERDE
Expectancy	+584,42		VERDE
Sharpe Ratio	3.09		VERDE
Sortino Ratio	4.13		VERDE
Calmar Ratio	9.21		VERDE
Win Rate	72.34%		AMARILLO
Máx. Drawdown	16.60%		AMARILLO

DESGLOSE POR TICKER				PnL neto (USD)
TICKER	OPS	WIN	PNL	
QQQ	10	80.00%	+8,539,68	
SOXL	6	66.67%	+10,433,26	
SPY	10	70.00%	+3,916,27	
TLT	11	81.82%	+4,661,00	
XLP	10	60.00%	-82,56	

SOXL

QQQ

TLT

SPY

XLP

\$10,433

\$8,540

\$4,661

\$3,916

\$-83

\$0k

\$2k

\$4k

\$6k

\$8k

\$10k

\$12k

Los indicadores deben evaluarse en conjunto y no de forma aislada. Estado **amarillo** indica métrica positiva que requiere lectura combinada con payout y drawdown.

GANADORAS / PERDEDORAS

34 / 13

Sobre 47 operaciones

RACHA MÁX. GANADORA

7

Operaciones consecutivas

RACHA MÁX. PERDEDORA

4

Operaciones consecutivas

GANANCIA MEDIA (USD)

+1.044,97

Promedio por trade ganador

TOP GANADORES INDIVIDUALES

SOXL · mejor trade	+4.065,78
SOXL	+3.981,12
SOXL	+3.725,77

TOP PÉRDIDAS INDIVIDUALES

SOXL · peor trade	-2.438,73
SOXL	-2.168,00
XLP	-735,87

RENDIMIENTO MENSUAL CONSOLIDADO

Mejor: 2025-08 +5.386,35 · Más exigente: 2025-12 -4.212,97

MES	PNL NETO (USD)	LECTURA
2025-01	+603,11	Inicio positivo con baja dispersión.
2025-02	-289,48	Corrección moderada y controlada.
2025-03	+951,21	Recuperación con continuidad operativa.
2025-04	+1.370,51	Expansión gradual de equity.
2025-05	+543,58	Avance estable.
2025-07	+3.895,93	Aceleración de performance.
2025-08	+5.386,35	Mes de mayor contribución neta.
2025-09	+4.338,53	Persistencia de ventaja estadística.
2025-11	+1.338,96	Tramo de consolidación positiva.
2025-12	-4.212,97	Evento adverso absorbido por gestión de riesgo.
2026-01	+3.725,77	Rebote técnico contundente.
2026-02	+3.038,94	Continuidad del tramo positivo.
2026-03	+3.937,90	Sostén de rendimiento robusto.
2026-04	+266,02	Mes neutral-positivo.
2026-05	+2.574,25	Nueva expansión del equity.
2026-06	-0,96	Cierre prácticamente neutro del corte.

Promedio por trade ganador: +1.044,97 USD · Promedio por trade perdedor: -620,10 USD · Distribución de cierres: reversión 45 (95.74%), stop loss 2 (4.26%).

DEFINICIONES Y FÓRMULAS			Serie de trades consolidada del broker	
MÉTRICA	DEFINICIÓN PRÁCTICA	FÓRMULA RESUMIDA		
Total Return	Variación porcentual del capital entre inicio y cierre.	$(Cap. \text{ final} / Cap. \text{ inicial}) - 1$		
Profit Factor	Relación entre ganancias brutas y pérdidas brutas.	$Gross \text{ Profit} / Gross \text{ Loss}$		
Expectancy	Ganancia o pérdida esperada por trade.	$PnL \text{ neto} / N.^{\circ} \text{ de trades}$		
Win Rate	Porcentaje de trades ganadores.	$Trades \text{ ganadores} / Trades \text{ totales}$		
Average Win / Loss	Magnitud promedio de resultados + y -.	$Prom(PnL>0), Prom(PnL<0)$		
Max Drawdown	Mayor caída relativa desde un máximo de equity.	$Max[(Peak - Equity) / Peak]$		
CAGR	Tasa anual compuesta equivalente del período.	$(Cap.f / Cap.i)^{(1/años)} - 1$		
Sharpe Ratio	Retorno ajustado por volatilidad total.	$Media \text{ ret.} / Desvío \text{ std ret.}$		
Sortino Ratio	Retorno ajustado solo por volatilidad bajista.	$Media \text{ ret.} / Downside \text{ deviation}$		
Calmar Ratio	Eficiencia retorno anual frente al drawdown máx.	$CAGR / Max \text{ Drawdown}$		

CONVENCIONES DEL ANEXO

- Métricas calculadas sobre los resultados del run cuenta live.
- Serie de trades consolidada del broker.
- Los indicadores deben evaluarse en conjunto, no de forma aislada.
- Trazabilidad completa en logs y CSV auditables.

TRANSPARENCIA OPERATIVA

- Fondos en cuentas a nombre del inversor, en brokers regulados.
- Cada operación es verificable directamente desde el broker.
- Sin manipulación manual de resultados ni balances internos.
- El sistema puede desconectarse en cualquier momento.

LOBO GRIS CAPITAL

Trading algorítmico automatizado sobre acciones e índices globales. Documento de referencia para validación de sistema. Los rendimientos pasados no garantizan resultados futuros. Invertir implica riesgo de pérdida de capital.

www.lobogris.capital
contacto@lobogris.capital

Administracion de cuenta

Progreso del capital del inversor aplicando el rendimiento diario del fondo compartido.



Captura 1 · Resumen de cuenta y curva de capital del inversor.

Historial diario, retiros y depositos

Detalle de rendimiento diario aplicado, solicitudes de retiro y depositos registrados.

Posiciones abiertas y cerradas

Historial diario

HISTORIAL DIARIO

Exportar XLS

FECHA	TIPO	MONTO	PNL	RETORNO	CAPITAL ACUMULADO	NOTA
2026-01-21	deposit	US\$ 40.000,00	-	-	US\$ 51.624,35	
2026-01-21	deposit	US\$ 10.000,00	-	-	US\$ 51.624,35	
2026-06-13	trader	-	-	+3,25%	US\$ 51.624,35	-
2026-06-16	trader	-	-	+3,88%	US\$ 53.628,92	-
2026-06-17	trader	-	-	-0,06%	US\$ 53.594,23	-
2026-06-18	trader	-	-	-0,29%	US\$ 53.438,64	-
2026-06-19	trader	-	-	+0,41%	US\$ 53.660,36	-

MIS SOLICITUDES DE WITHDRAWAL

FECHA	MONTO SOLICITADO	MONTO CONFIRMADO	ESTADO
No hay solicitudes			

MIS DEPÓSITOS

FECHA	MONTO	NOTA
2026-06-21	US\$ 0,00	Capital inicial
2026-01-21	+US\$ 40.000,00	-
2026-01-21	+US\$ 10.000,00	-

Captura 2 · Historial diario, solicitudes de withdrawal y depositos.