

INFORME GENERAL DE VALIDACION

ALG-EA-001 - ERIKA

Laboratorio Algoritmico | MetaTrader 4 | Expediente de investigacion

Estado	EXPERIMENTO CERRADO - NO VALIDADO
Plataforma	MetaTrader 4
Capital base de los tests	10.000
Activos estudiados	SILVER y GOLD
Temporalidades documentadas	M30 y H1
Mejor resultado documentado	+570,17 PF 1,56 DD max. 3,66% 40 trades

Resumen ejecutivo

ERIKA fue una linea experimental de Expert Advisors creada para estudiar la evolucion de una idea automatizada mediante filtros de tendencia, momentum, estructura de mercado y gestion dinamica del riesgo. Las primeras versiones mostraron perdidas severas. Las versiones posteriores redujeron radicalmente el drawdown y ERIKA V3.4 llego a producir resultados historicos positivos en SILVER M30. Sin embargo, la ventaja no se mantuvo con la misma consistencia al cambiar temporalidad o activo. Por ello, el Laboratorio no considera ERIKA validada para operativa real.

Este documento no pretende demostrar rentabilidad futura. Su objetivo es conservar el proceso de investigacion, incluidos los resultados negativos, y extraer lecciones utiles para desarrollos posteriores.

1. Hipotesis y arquitectura estudiada

La hipotesis de trabajo fue que una estrategia automatizada podia mejorar su selectividad combinando filtros de tendencia con confirmaciones de fuerza y una gestion del riesgo adaptativa. A lo largo de la evolucion se estudiaron medias moviles, ADX, RSI, pullbacks, soportes y resistencias, ATR, Stop Loss estructural, Break Even, trailing dinamico y bloqueo progresivo de beneficio.

Criterios de evaluacion

Los tests se interpretaron conjuntamente mediante beneficio neto, Profit Factor, drawdown, numero de operaciones, porcentaje ganador, estabilidad entre periodos y sensibilidad al cambio de activo o temporalidad. Una curva positiva aislada no se considero suficiente para validar el sistema.

2. Evolucion de las versiones

ERIKA V1

Primera base funcional. En SILVER M30 produjo -6.944,67, PF 0,56, drawdown maximo 79,57%, 647 operaciones y 31,53% ganadoras. El riesgo y la frecuencia operativa eran inaceptables.

ERIKA V2

Se endurecieron los filtros de tendencia y reentrada. La perdida se redujo a -5.412,31, pero PF 0,54 y DD 59,37% seguian descartando la configuracion.

ERIKA V3

Cambio de arquitectura con filtros mas estrictos. El drawdown descendio con fuerza, pero solo se generaron 5 operaciones: -160,35 y PF 0,19. La muestra era insuficiente.

ERIKA V3.3

Mayor control de tendencia y volatilidad. Resultado -117,63, PF 0,82, DD 4,16% y 25 trades. La gestion del riesgo mejoro, pero aun no existia ventaja estadistica.

ERIKA V3.4

Objetivo 3R, Break Even y trailing mas tardios y bloqueo progresivo de beneficio. Fue la version mas prometedora, especialmente en SILVER M30, aunque no demostro robustez transversal.

3. Tabla maestra de resultados

Prueba	Activo	TF	Neto	PF	DD max.	Trades	Gan.
V1	SILVER	M30	-6.944,67	0,56	79,57%	647	31,53%
V2	SILVER	M30	-5.412,31	0,54	59,37%	366	34,15%
V3	SILVER	M30	-160,35	0,19	1,87%	5	20,00%
V3.3	SILVER	M30	-117,63	0,82	4,16%	25	48,00%
V3.4	SILVER	M30	+206,16	1,32	3,16%	25	48,00%
V3.4 largo	SILVER	M30	+570,17	1,56	3,66%	40	50,00%
V3.4 largo	SILVER	H1	-219,82	0,72	4,23%	24	33,33%
V3.4 GOLD	GOLD	M30	+72,01	1,08	3,88%	32	40,62%

Nota: las pruebas historicas disponibles presentan distintas calidades de modelado y, en algunos casos, errores de desalineacion. Por tanto, las cifras son evidencia de backtest, no una garantia de comportamiento futuro.

4. Analisis de la evolucion

Reduccion del riesgo

El cambio mas claro fue la reduccion del drawdown. V1 y V2 mostraron deterioros incompatibles con una operativa prudente. Las versiones V3.x redujeron el riesgo a niveles mucho menores, lo que confirma que los filtros y la gestion dinamica modificaron de forma sustancial el perfil del sistema.

Coste de la selectividad

La mejora del drawdown tuvo un coste: el numero de operaciones cayo de centenares a decenas e incluso a solo cinco en una de las pruebas. Un sistema excesivamente filtrado puede parecer estable porque participa muy poco en el mercado; eso dificulta obtener una muestra estadistica suficiente.

El punto de inflexion: V3.4

V3.4 fue el primer salto claramente positivo. En la prueba ampliada de SILVER M30 obtuvo +570,17, PF 1,56, DD maximo 3,66%, 40 operaciones y un 50% de operaciones rentables. Es un resultado interesante, pero 40 operaciones siguen siendo una muestra limitada para afirmar robustez.

5. Prueba de robustez

La prueba mas reveladora fue trasladar V3.4 desde SILVER M30 a SILVER H1. El resultado cambio a -219,82 con PF 0,72. La misma logica, aplicada a otra temporalidad, perdio la ventaja observada en M30. En GOLD M30 el resultado fue ligeramente positivo (+72,01), pero con PF 1,08, demasiado cercano al umbral neutro para considerarlo una confirmacion fuerte.

Esta sensibilidad al entorno es el motivo principal por el que ERIKA no supera la fase de validacion. Un sistema robusto deberia mostrar una ventaja razonablemente estable ante cambios moderados de muestra, periodo, temporalidad y activo, sin depender de una configuracion excesivamente especifica.

6. Calidad y limitaciones de los datos

Los informes disponibles muestran calidades de modelado aproximadamente entre 54,82% y 67,04%, y algunos tests contienen errores de desalineacion. Estas limitaciones reducen la fuerza probatoria de los resultados. Por ello,

el Laboratorio utiliza estas pruebas principalmente para comparar versiones y estudiar el proceso de desarrollo, no para realizar afirmaciones de rentabilidad futura.

7. Lecciones aprendidas

1. Reducir drawdown no basta.

Una mejora del control de riesgo es necesaria, pero debe coexistir con una ventaja estadística reproducible.

2. Mas filtros pueden destruir la muestra.

Filtrar demasiado puede reducir operaciones hasta un punto en el que el backtest deja de ser representativo.

3. Un activo y una temporalidad no validan un EA.

El resultado de SILVER M30 no se reprodujo en SILVER H1 con la misma consistencia.

4. Profit Factor cercano a 1 exige cautela.

Resultados ligeramente positivos pueden desaparecer con costes, spread, ejecucion o cambios de mercado.

5. Los resultados negativos tambien son informacion.

V1 y V2 permitieron identificar exceso de exposicion; V3.x mostro el problema opuesto: exceso de selectividad.

6. La validacion debe ser mas exigente que la optimizacion.

Encontrar parametros que funcionaron en el pasado no equivale a demostrar que la logica es estable.

8. Veredicto final del Laboratorio

EXPERIMENTO CERRADO - NO VALIDADO PARA OPERATIVA REAL

ERIKA consiguio una evolucion tecnica relevante: paso de drawdowns extremos y perdidas severas a una version V3.4 capaz de producir backtests positivos con un riesgo historico mucho menor. Sin embargo, las pruebas disponibles no demuestran una ventaja suficientemente estable entre temporalidades y activos, y la calidad de los datos historicos limita cualquier conclusion definitiva.

La decision del Laboratorio es cerrar ALG-EA-001 como experimento no validado. No se presenta como producto rentable, robot recomendado ni sistema preparado para cuenta real. Se conserva como expediente de investigacion y como base de aprendizaje para futuros desarrollos.

9. Transparencia y advertencia

Formacion Forex publica tanto los resultados favorables como los desfavorables. Los backtests son simulaciones historicas y no garantizan resultados futuros. Este informe tiene finalidad educativa y de investigacion y no constituye asesoramiento ni recomendacion de inversion.

Formacion Forex - Laboratorio Algoritmico - ALG-EA-001 ERIKA