

ESTADÍSTICAS 2024

martes, 31 de diciembre de 2024

INTRODUCCIÓN

Este año 2024 se ha caracterizado por dos eventos completamente opuestos, la continuación del drawdown de TENAZ y el espectacular desempeño de SAGAZ. El resto de estrategias han ido bien, como AUDAZ, o han tenido un rendimiento nulo como COSTA. Los algoritmos que generan las operaciones en AUDAZ y COSTA se han rediseñado para 2025 por razones que se explicarán en este informe.

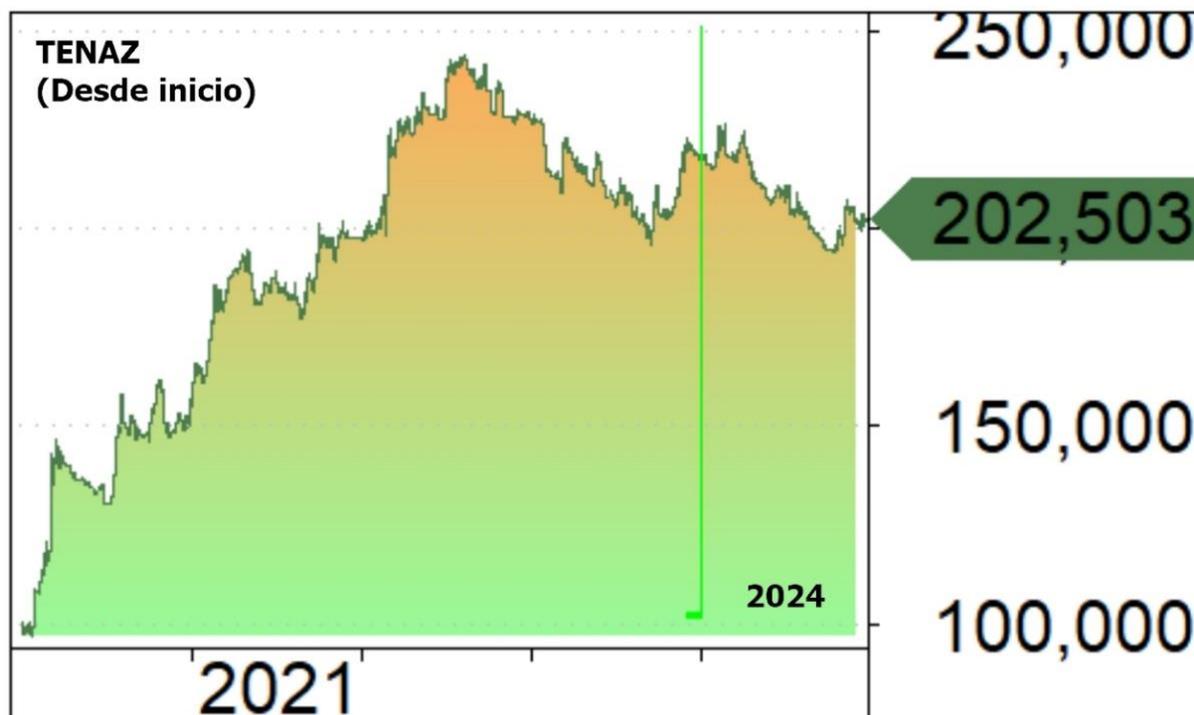
Aparte, en octubre comenzó a operar la estrategia VIVAZ, así que veremos su desempeño en el periodo de operativa real. Y finalmente, en 2025 comienza la estrategia TREND, que no tiene aún evolución en tiempo real y por tanto no se considerará en este documento de estadísticas.

TENAZ

En la página siguiente vemos la evolución de TENAZ desde su comienzo y resaltando el año 2024 a partir del marcador vertical verde. En 2024 TENAZ ha tenido una rentabilidad del -15.8%. El desempeño de los últimos dos años y medio se ha visto limitado por la ausencia de tendencias estables en los 11 mercados operados. Sin embargo, los análisis indican que estas condiciones son transitorias y no reflejan fallos en el algoritmo. Los ajustes implementados para 2025 buscan capitalizar en mercados más tendenciales, como el futuro del azúcar, para mejorar los resultados. Veamos...



Prohibida su distribución. La inversión en bolsa tiene riesgo. Utilice siempre Stop-Loss. Onda4 no se responsabiliza de las operaciones de sus seguidores. Onda4 puede utilizar este material en ofertas y/o promociones en su web.



Entre sus mercados, TENAZ opera el futuro del índice SP500, un mercado que ha aumentado su volatilidad progresivamente. El SP500 ha formado parte de TENAZ desde el comienzo, pues aporta diversificación, pero al ser un índice tiene un desempeño pobre en modelos tendenciales, y su aumento de volatilidad ha impedido la operativa recientemente. Por estas razones, lo sustituimos por el futuro del Sugar #11, un mercado muy líquido, tendencial, y con una volatilidad mucho más apropiada. Las pruebas indican que este cambio debería mejorar los resultados en operativa real.

Además, TENAZ cambia la forma en la que se calcula el número de contratos a operar. El nuevo cálculo favorece las operaciones en los mercados menos volátiles del portafolio, o en los mismos mercados cuando están en una situación de baja volatilidad. El comportamiento en tiempo real y las pruebas han dejado claro que las roturas o breakouts que comienzan desde baja volatilidad son mucho más fiables y duraderas que si comienzan con una volatilidad elevada.

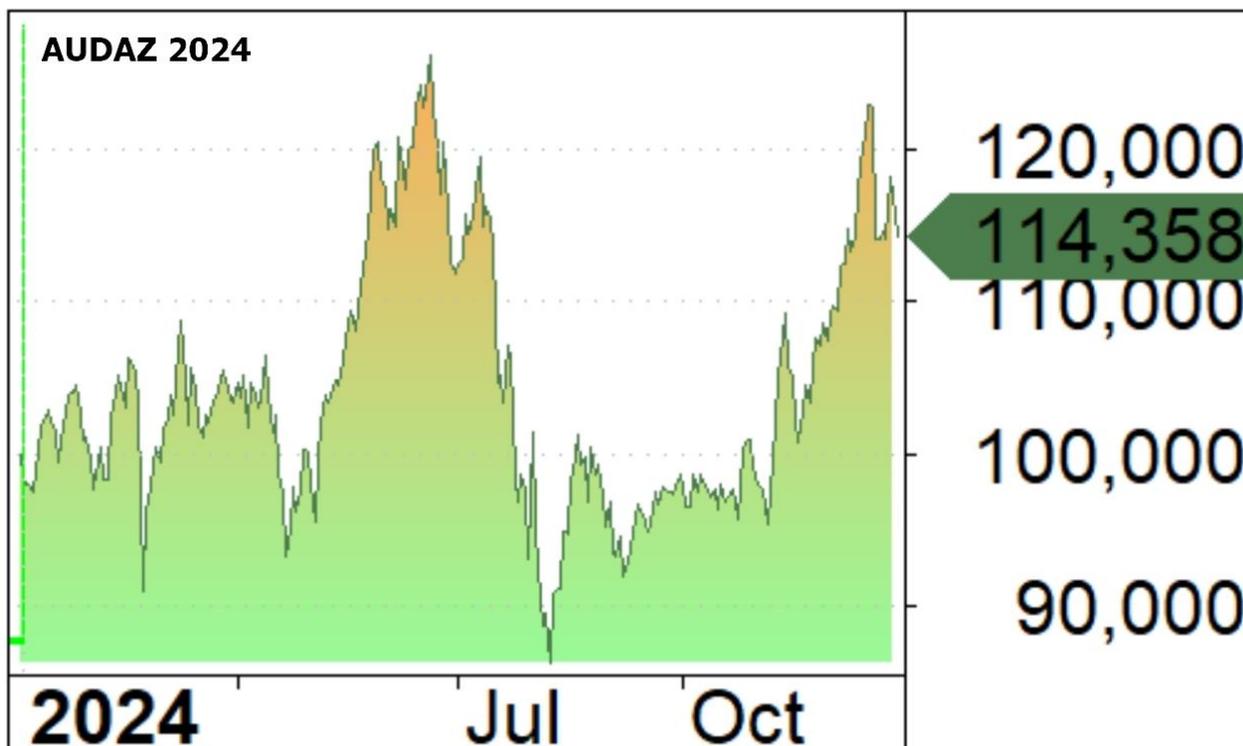
TENAZ comenzó su operativa en 2020, y aunque acumula un rendimiento del 102% desde su comienzo, el pasado reciente no es favorable en absoluto. Las estrategias de roturas suelen tener periodos prolongados de rendimientos negativos y TENAZ no es ninguna excepción. Con los cambios realizados y teniendo en cuenta que no se ha encontrado ningún problema con la lógica, parece razonable pensar que en algún momento veremos una evolución de TENAZ similar a la de los tres primeros años, aunque no hay ninguna garantía de que esto ocurra. Si durante 2025 hubiera algún evento o noticia importante en Algodón, Soja, Trigo, Azúcar, Crudo, Oro... y que tenga impacto en su precio volveremos a ver las bondades de la lógica de roturas.

AUDAZ

La estrategia AUDAZ opera acciones del Nasdaq100. Termina el año con una rentabilidad del 14.63%, de los cuales el 14.36% es operativa y un 0.27% correspondiente a la divisa, como suma del efecto divisa y la cobertura.

Debajo vemos dos rallies en la curva de capital. El primero se corresponde con la compra del valor Nvidia. El segundo, y vigente a fin de año, se corresponde con la compra del valor Tesla.

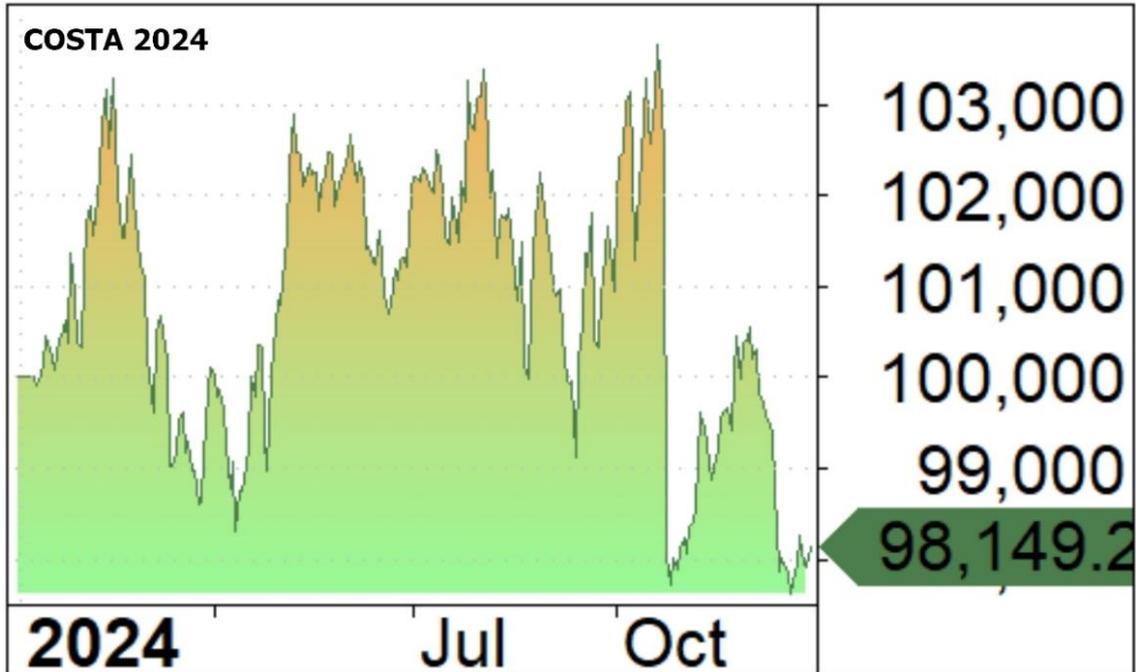
Aunque AUDAZ tiene una buena rentabilidad desde que comenzó a operar, el año anterior, 2023, fue plano, y este año ha tenido una importante devolución de ganancias al terminar la primera mitad. Se ha rediseñado la estrategia AUDAZ mejorando el criterio de selección de activos, para incorporar criterios adicionales y evitar comprar valores al final de su ciclo de subida. También se incorpora un stop loss a nivel de portfolio, con lo que se reduce el riesgo total. Si desea conocer los detalles, estos se explican en la documentación actualizada: <https://www.onda4.com/files/audaz.pdf>



COSTA

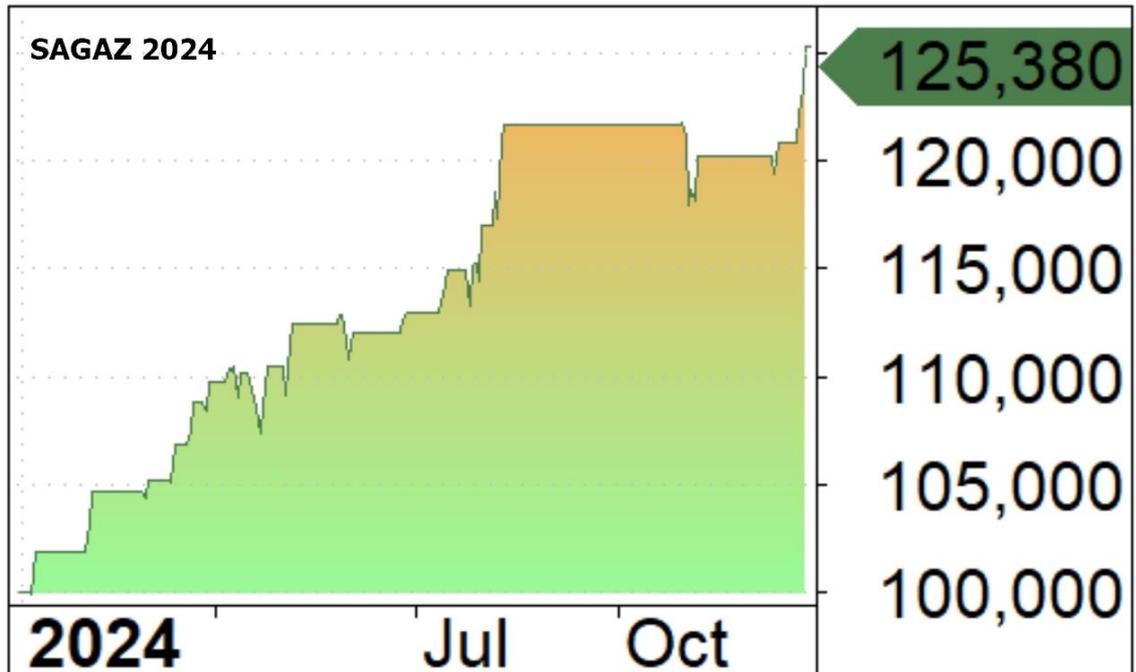
Su evolución en 2024 es plana o ligeramente negativa (-1.8% incluyendo comisiones). Aunque la operativa de pares se basa en un concepto sólido y rentable, hay muchas formas de implementarla y es aquí donde se han decidido implementar cambios. La estrategia se rediseña con las siguientes mejoras:

Prohibida su distribución. La inversión en bolsa tiene riesgo. Utilice siempre Stop-Loss. Onda4 no se responsabiliza de las operaciones de sus seguidores. Onda4 puede utilizar este material en ofertas y/o promociones en su web.



Se sustituye el test de estadístico de Dickey-Fuller por el test de Engle-Granger, mucho más apropiado para evaluar la cointegración de los pares. Aparte, se cambia el criterio operativo y el método de dimensionamiento. Aquí tiene los detalles: <https://www.onda4.com/files/costa.pdf>

SAGAZ



Prohibida su distribución. La inversión en bolsa tiene riesgo. Utilice siempre Stop-Loss. Onda4 no se responsabiliza de las operaciones de sus seguidores. Onda4 puede utilizar este material en ofertas y/o promociones en su web.

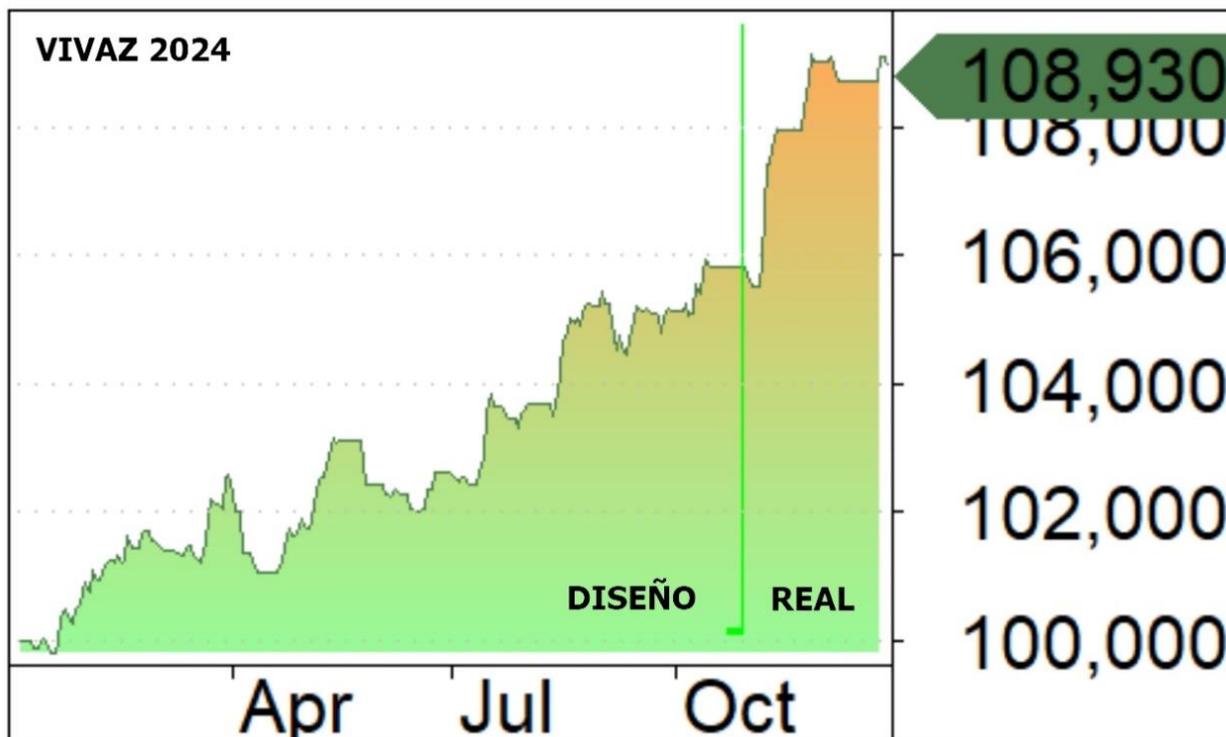
La estrategia SAGAZ para el índice SPX ha tenido un rendimiento del 25.4% durante 2024. Sus ratios son impresionantes:

- Recovery Factor: 6.64
- Profit factor: 15.15
- Ratio Sharpe: 8.21

Solamente por citar algunos de ellos. El porcentaje de aciertos del 88% en tiempo real también ha sido un factor muy importante para una operativa cómoda y rentable. No habrá cambios en SAGAZ.

VIVAZ

Opera el índice Dow Jones con CFDs. Empezó a finales de octubre tal y como vemos debajo. Por el momento su desempeño es igual o mejor que en el diseño, y se espera que continúe pues es una estrategia con una lógica muy simple basada en el hueco de apertura del Dow Jones, tanto para abrir posiciones como para cerrarlas.



RESUMEN

El año 2024 ha sido un periodo de contrastes, con estrategias como SAGAZ alcanzando un rendimiento excepcional del 25.4%, mientras que TENAZ y COSTA han enfrentado desafíos importantes que ya se están abordando con rediseños estratégicos. La incorporación de nuevas metodologías y ajustes en algoritmos garantiza que nuestras estrategias se mantengan sólidas frente a mercados cambiantes.

Destacamos los siguientes puntos clave:

- **Éxitos sobresalientes:** SAGAZ continúa demostrando ratios impresionantes (Recovery Factor: 6.64, Profit Factor: 15.15, y un ratio Sharpe de 8.21), consolidándose como una estrategia líder. AUDAZ, por su parte, cierra con un rendimiento del 14.36%.
- **Aprendizajes y ajustes:** TENAZ y COSTA han enfrentado retos en 2024, pero las pruebas realizadas validan sus fundamentos. Las modificaciones implementadas, como la sustitución del SP500 por futuros del azúcar en TENAZ y nuevos criterios operativos en COSTA y AUDAZ, se traducirán en una mayor adaptabilidad.
- **Nuevas oportunidades:** VIVAZ, que comenzó operaciones en octubre, ya muestra un desempeño prometedor, y la estrategia TREND amplía el horizonte de posibilidades en 2025. Con mucha probabilidad, si durante 2025 aparece una fuerte tendencia, la estrategia TREND la aprovechará al máximo.

Con un enfoque en la diversificación, innovación y mejora continua, las seis estrategias ofrecen soluciones robustas para diferentes tamaños de cartera y preferencias de mercado. Onda4 seguirá adaptándose para maximizar el potencial de inversión en cualquier entorno financiero.