

1. CONFIGURACIONES



Los backtest son una herramienta fundamental a la hora de evaluar un bot de Forex.

En ellos podemos encontrar numerosos datos de relevancia acerca de los resultados que tuvo un bot concreto en el pasado. En este documento aprenderás a interpretar los backtest que tienes disponibles en la web para cada producto de Bitfrex Bot.

Dependiendo de la estrategia que utilice el bot, se tienen en cuenta ciertos apartados del backtest, ya que otros resultan irrelevantes.

Aquí veremos los datos a tener en cuenta a la hora de evaluar un bot con estrategia de coberturas, tal y como lo son el Bitfrex Bot Mini y el Bitfrex Bot Full.

Symbol: Te indicará el par de divisas con el que se ha efectuado el backtest y al que pertenecen los resultados expuestos en el documento.

Period: Time frame en el que se opera y fecha de inicio y fin del backtest. El documento muestra las operaciones y todos los resultados obtenidos durante dicha fecha.

Parámetros: Aquí encontrarás las configuraciones exactas con las que está programado el bot a la hora de efectuar el backtest. Haber tenido esas configuraciones programadas en tu Bitfrex Bot, durante el período de tiempo estipulado, te hubiese garantizado los resultados mostrados en el documento.

Modelling quality: Aquí se muestra el grado de precisión del backtest. Es importante nunca fiarse de un backtest que tenga menos de un 90% de calidad de modelado. Pero lo ideal es que marque 99.9 o N/A, que representa el grado máximo de precisión.

Initial deposit: indica la cantidad con la que el bot ha empezado a operar.

Total net profit: indica la cantidad que el bot ha obtenido de beneficio neto durante el período establecido.

Profit factor: indica cuanto beneficio obtiene el bot por cada dólar que pierde. Es la relación entre ganancias brutas y pérdidas brutas. Si fuese 1, el bot no estaría obteniendo ni pérdidas ni ganancias. Por encima de 1.2, indica un buen resultado. 1.5 o superior, son resultados muy buenos. Normalmente, a mayor profit factor, más beneficios, pero también más riesgo.

Absolute drawdown: El punto más bajo que alcanza tu balance respecto a tu depósito inicial, representado en saldo (unidades monetarias).

Maximal drawdown: La cantidad máxima de operaciones abiertas en el balance (flotante), en cuanto a saldo se refiere, que llega a tener la cuenta en un momento determinado.

Relative drawdown: La cantidad máxima de operaciones abiertas en el balance (flotante), en cuanto a porcentaje se refiere, que llega a tener la cuenta en un momento determinado.

Total trades: En este apartado encontrarás todas las operaciones hechas, divididas en posiciones cortas y largas. Entre paréntesis verás los porcentajes de las operaciones ganadas y perdidas. 51% o superior, de operaciones ganadas, indica una estrategia ganadora si siempre se gana y pierde la misma cantidad de capital.

2. RECOMENDACIONES



Bitfrex
BOT

Para realmente identificar si un bot de coberturas es bueno y saber cuánto capital depositar en la cuenta para ponerlo a operar, podríamos simplificarlo todo y fijarnos simplemente en 2 tipos de parámetros: el resultado en cuanto a beneficio y los drawdown.

Los dos primeros parámetros a tener en cuenta son el **total net profit** y el **profit factor**. Con esto identificaremos si los beneficios obtenidos por el bot, en el período estudiado, son lo suficientemente atractivos para nosotros.

De ser así, sólo queda determinar el capital inicial a aportar para poner el bot a funcionar con la estrategia en cuestión. Para hacer esto, no debemos limitarnos a ver con que capital empezó el bot a operar en el backtest (**initial deposit**).

Las estrategias de coberturas son muy rentables si se sabe como sacarles partido. Cuando se encuentra una estrategia ganadora, sólo se trata de poner capital de sobra y dejar que el bot haga su trabajo.

En algunos de los backtest podrás ver como hay veces que el **maximal y relative drawdown** son superiores al **initial deposit**. El motivo por el que el bot no quema la cuenta en estos casos, es porque esas caídas momentáneas de balance ocurrieron cuando el bot ya había generado ganancias suficientes como para soportarlas.

¿Pero que habría pasado si estos movimientos bruscos de mercado hubiesen ocurrido el día después de poner el bot en marcha con ese balance concreto que se indica en el **initial deposit**?

Perderíamos nuestro dinero.

Por eso, cuando una estrategia nos gusta, lo que te recomendamos desde Bitfrex es que el capital inicial se establezca teniendo en cuenta los **maximal y relative drawdown**. Depositando una cantidad siempre superior al mayor de estos dos parámetros.

Esto te aseguraría haber podido soportar la mayor caída de mercado durante ese período de tiempo, sin tener en cuenta en que momento empezó tu bot a operar.

Si te estás preguntando cuanto más capital deberías depositar, la respuesta es sencilla: cuanto más mejor.

Existe una práctica llevada a cabo por la mayoría de los usuarios que operan con bots de Forex, que creemos errónea cuando consideramos que tratamos con bots de coberturas. Mucha gente cree entender que poner más pares de divisas a operar en un solo bot es la estrategia adecuada.

Realmente, lo importante es asegurar el perfecto funcionamiento de uno de los pares, sin escatimar en capital. Si revisas los backtest del Bitfrex Bot Full verás que, en muchos casos, no se necesita más que operar con un par de divisas para conseguir resultados impresionantes en el medio-largo plazo.

Para conseguirlo, creemos preferible invertir capital en asegurar el funcionamiento de un par de divisas en un bot, antes que invertir en abrir otros pares de divisas teniendo un capital mínimo en ambas. Nunca será una equivocación poner \$1000 o más de lo que marquen el **maximal y relative drawdown**. Más vale ser conservador y tener así más posibilidades de éxito largo-placistas.

Por último, recordarte que los resultados pasados no garantizan resultados futuros. Pero te serán de guía y gran utilidad para asentar las bases de cualquier estrategia.