Tu backtest bajo sospecha

Aprende a detectar fallos antes de aceptar una curva.

La lista completa de comprobación y un caso sintético resuelto, extraídos del manual.

Elian Ortiz

Muestra de la edición 1.3.3 · Gratis

> Material educativo. El caso es una simulación con datos sintéticos; no es asesoría de inversión ni una promesa de rentabilidad.

Una curva no es una prueba

El manual enseña a revisar evidencia: qué puede comprobarse, qué falla y qué sigue pendiente.

Está pensado para quienes compran o evalúan asesores expertos (EAs). Puedes seguir las preguntas y el caso sin programar. Para ejecutar los ejercicios del paquete completo necesitas Python 3.10+, numpy y pandas.

Seis puertas para no saltarse lo incómodo

Revisión	Pregunta de entrada
Definición y ejecución	¿La regla está definida y la operación concilia, incluidos los cargos?
Información y selección	¿Se usó futuro? ¿Cuántas variantes se probaron?
Validación y dictamen	¿Queda una reserva intacta y qué conclusión permite la evidencia?

Qué encontrarás aquí

La página siguiente conserva la hoja imprimible completa (12 comprobaciones). Después vienen las cuatro páginas literales del único caso resuelto incluido, tomadas de las pp. 40–43 del manual; la hoja procede de la p. 44. Solo cambian los pies y los enlaces internos de navegación.

> Para completar la hoja, marca sí, no o pendiente y anota un archivo de respaldo. Una ausencia no equivale a aprobación. En el caso resuelto podrás contrastar tus respuestas.

Una cifra necesita su contexto

Cita literal del ejercicio 4, p. 25 del manual completo (ese ejercicio no se incluye en esta muestra):

> El ruido arroja PBO **0,731602** y DSR **0,006721**; el control con señal plantada arroja PBO **0,000000** y DSR **0,999999995**, bajo el generador y los supuestos de esta corrida.

Esas cifras pertenecen a otra demostración sintética, no al caso de las páginas siguientes. Ni PBO ni DSR sustituyen una auditoría completa.

> Los comandos y las rutas citados en el caso remiten a los archivos del manual completo. Esta muestra PDF no incluye scripts ni notebooks. Las referencias abreviadas de la hoja se desarrollan en la bibliografía del manual.

Checklist final de auditoría

Marca sí / no / pendiente y el archivo de evidencia. Fecha: _____ Objeto y versión: _____

Comprobación	Estado y respaldo
Reglas: Entradas, salidas, tamaño, riesgo y eventos reproducibles.	☐ Sí ☐ No ☐ Pendiente Evidencia: _____
Datos: Origen, fechas, universo, bajas, huecos y ajustes documentados.	☐ Sí ☐ No ☐ Pendiente Evidencia: _____
Tiempo: Variables disponibles antes de decidir; primer precio ejecutable.	☐ Sí ☐ No ☐ Pendiente Evidencia: _____
Ejecución: Convención para órdenes, stops, gaps, ambigüedad, capacidad y rechazos.	☐ Sí ☐ No ☐ Pendiente Evidencia: _____
Costos: Spread, comisión por lado, slippage y tenencia conciliados; observado y supuesto.	☐ Sí ☐ No ☐ Pendiente Evidencia: _____
Unidad: R, puntos, dinero, exposición y curva: denominadores compatibles.	☐ Sí ☐ No ☐ Pendiente Evidencia: _____
Búsqueda: Variantes, rondas y métrica; también los intentos descartados. (Sullivan et al., 1999)	☐ Sí ☐ No ☐ Pendiente Evidencia: _____
Reserva: Holdout, accesos, fronteras y walk-forward con alcance declarado. (Pardo, 2008) (Arnott et al., 2019)	☐ Sí ☐ No ☐ Pendiente Evidencia: _____
Incertidumbre: Dependencia, episodios, efecto y multiplicidad tratados o limitados. (Harvey y Liu, 2015)	☐ Sí ☐ No ☐ Pendiente Evidencia: _____
Auditor: Controles negativos y positivos; magnitudes y sensibilidad declaradas.	☐ Sí ☐ No ☐ Pendiente Evidencia: _____
Reproducción: Configuración, semilla, salidas y figuras reproducen el resultado.	☐ Sí ☐ No ☐ Pendiente Evidencia: _____
Dictamen: Resultado, criterio incumplido y pendientes; sin recomendación personal.	☐ Sí ☐ No ☐ Pendiente Evidencia: _____

Dictamen _____

Fallo principal o límite _____

Dato que podría cambiarlo _____

El informe recibido no supera la primera revisión

Un resultado llamativo, una operación conciliada y dos fallos que puedes repetir.

> **Todo este caso es ficticio.** Los precios, operaciones e informe los genera un script determinista. No procede de una cuenta ni describe una estrategia de mercado.

Puerta de definición. Recibimos una curva bruta de 120 barras generadas con semilla 20261025. El precio inicial es 100,00 unidades; cada R equivale a 0,20 unidades de precio. Cada viaje ocupa una barra y usa tamaño fijo; no se reinvierte.

La posición publicada toma el signo del siguiente cambio. La reparación usa el último cambio ya conocido. No hay stops ni huecos en el generador. Capacidad, latencia y rechazos quedan pendientes: esta simplificación no acredita ejecución real.

Puerta de ejecución: conciliar una fila

Campo de la operación sintética	Valor
Entrada en t / salida en t siguiente	10 / 11
Precio de entrada / salida	101,061763972 / 100,779379473
Dirección publicada	−1
Bruto = dirección × (salida − entrada) / R	+1,411922 R
Spread + comisión + slippage por viaje	0,04 + 0,02 + 0,02 R
Neto = bruto − cargos	+1,331922 R

Los cargos son supuestos explícitos y ya representan el viaje completo. La fila concilia aritméticamente, pero su posición exige el precio de salida antes de entrar. Cuadrar una cuenta no vuelve posible una operación.

Origen de todas las cifras: figuras/05_caso_auditoria.json, claves barras, semilla, unidad_R y operacion. Continúa con la prueba de información.

Cambia el futuro y observa qué decisión se mueve

Puerta de información. Conservamos el precio y todo el pasado hasta el índice 80. Reflejamos los precios posteriores alrededor del último precio conocido. El historial anterior queda idéntico; una regla causal debe conservar sus decisiones hasta el corte, incluido.

Prueba de futuro	Decisiones pasadas alteradas
Regla publicada: signo del siguiente movimiento	1
Reparación: signo del último movimiento	0

Fallo reproducido. La decisión del corte cambia cuando solo cambiamos información que todavía no existía. Esto localiza la filtración: `sign(diff(precio))` se utiliza como posición del mismo intervalo. La reparación desplaza esa información una barra.

Una reparación que modifica la conclusión

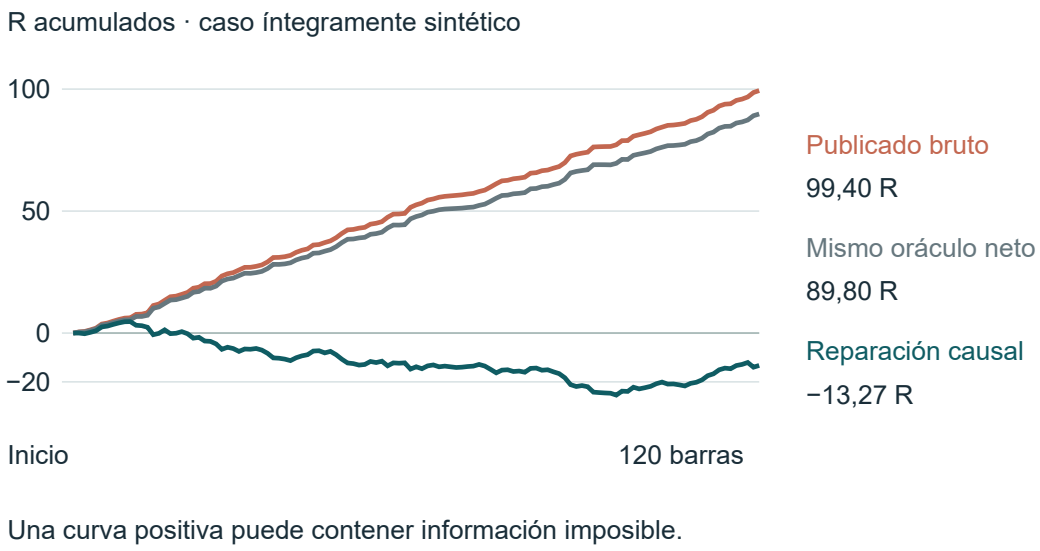


Figura 5. Salidas del caso sintético: bruto publicado, mismo oráculo con cargos y regla causal con cargos. No son resultados de trading real.

Puerta de selección. El supuesto proveedor ficticio no entrega historial de búsqueda. La cantidad de variantes queda pendiente; no se sustituye el dato ausente por una hipótesis de prueba única.

Puerta de validación. El tramo final ya fue observado. La reparación da allí +1,209864 R, pero esa cifra no es una confirmación independiente. Habría que congelar la reparación y reunir una nueva muestra.

JSON: prueba_futuro, curvas y agregados. El autochequeo usa una operación trabajada y el contraste oráculo/causal; no mide potencia estadística.

Fallo reproducido: retira la conclusión de rentabilidad

Puerta de dictamen. La curva publicada usa información futura y omite cargos. Esos hechos invalidan su lectura como rentabilidad ejecutable. No necesitamos PBO o DSR para demostrar este fallo.

Agregado conciliado	R
Bruto publicado · 120 viajes	+99,401697
Cargos omitidos	9,600000
Mismo oráculo neto	+89,801697
Suma independiente de las filas netas	+89,801697
Reparación causal neta · 119 viajes	−13,268004

El bruto menos los cargos recupera el neto del mismo oráculo; la suma de operaciones también. La reparación causal reduce el total y comienza sin posición. Su resultado es otra prueba, con una regla distinta: no es una simple corrección contable del informe recibido.

> **Decisión:** conservar el informe, el script y el fallo; retirar la afirmación de rentabilidad. Antes de otra evaluación: fijar reglas causales, cargos, búsqueda, acceso a datos y criterio de rechazo.

Qué queda abierto

La ejecución real no se modeló; falta historial de variantes y no queda una reserva intacta. No se calculan incertidumbre, multiplicidad ni potencia. El contraste temporal comprueba una propiedad concreta del auditor; no acredita sensibilidad a una ventaja económica.

Reproducir la entrega

```
python -B ejercicios/05_caso_auditoria.py
```

La salida indica **FALLO REPRODUCIDO** y **Autochequeo OK**. Entrega el dictamen de esta página, la fila conciliada y la prueba de futuro. El checklist completo permite revisar lo afirmado.

Fuentes numéricas: 05_caso_auditoria.json, agregados y operacion. Las dos sumas deben coincidir dentro de tolerancia de coma flotante, verificada en el script.

Cada estado conserva su evidencia

Objeto: informe ficticio generado por `05_caso_auditoria.py`. El estado evalúa lo recibido y reconoce las pruebas disponibles después de la auditoría. «Pendiente» conserva una ausencia; no equivale a aprobación.

Comprobación	Estado	Respaldo en el JSON o el script
Reglas	Sí	reglas: viaje de una barra; posición publicada y reparación definidas.
Datos	Sí	datos: paseo generado; sin bajas, ajustes ni observaciones faltantes.
Tiempo	No	prueba_futuro: la decisión del corte cambia al invertir el futuro.
Ejecución	Pendiente	reglas: no hay ticks, gaps, stops, capacidad ni rechazos simulados.
Costos	No	agregados: el informe publicado es bruto y omite cargos explícitos.
Unidad	Sí	operacion: bruto y neto en la misma unidad R fija.
Búsqueda	Pendiente	historial_busqueda: no entregado; no se supone una sola prueba.
Reserva	No	reserva: tramo final ya visto; no es una confirmación independiente.
Incertidumbre	Sí	limites: no se estima significación ni ventaja de mercado.
Auditor	Pendiente	autochequeo: contraste temporal ejecutado; falta sensibilidad ante una ventaja económica.
Reproducción	Sí	05_caso_auditoria.py, su JSON y su figura permiten repetir este caso.
Dictamen	Sí	dictamen: fallo reproducido, sin extrapolar rentabilidad.

En «Costos» se marca «No» porque el informe original los omite, aunque la auditoría sí los reconcilia. En «Auditor» queda «Pendiente»: el contraste temporal se ejecutó, pero falta comprobar sensibilidad a una ventaja económica.

Fuente: 05_caso_auditoria.json, checklist. Conserva las doce respuestas y sus límites al preparar tu propia revisión. La hoja imprimible queda disponible para otro objeto.

SIGUE CON EL MANUAL COMPLETO

Del informe al dictamen

Tu backtest bajo sospecha
Edición 1.3.3 · Elian Ortiz

Qué recibes	Alcance
PDF de 52 páginas	Costos, información futura, selección, PBO/CSCV, PSR/DSR y seis puertas de revisión.
Cinco scripts y cinco notebooks	Ejercicios con datos sintéticos y supuestos declarados.
Tres soluciones ejecutables	Extensiones de los ejercicios; instrucciones en LEEME.md.
Caso resuelto y hoja imprimible	De la fila conciliada al dictamen y al checklist contestado.

COP 59.900

Precio del manual completo · pago único.

Consulta la ficha de venta de ORPALAB antes de comprar: verifica el precio final con impuestos, la identidad del vendedor, las condiciones de entrega y tus derechos. Esta muestra no es un checkout ni acredita que la tienda esté publicada.

> **No incluye:** señales, recomendación personalizada, certificación de estrategias, auditoría automática de tu EA ni un motor completo de walk-forward sobre tus datos. Los estudios internos citados no forman parte del paquete.

Pide evidencia, no una promesa.

Material educativo. Simulaciones con datos sintéticos; no predicen resultados futuros ni son asesoría de inversión.