

TAREA TÉCNICA

El EA debe cumplir con estas condiciones principales:

1-Toda operación que tome el EA debe ser con un riesgo beneficio de al menos 1:2 ó 1:2.5

2-Demostrado mediante backtesting (preferiblemente Monte Carlo o walk-forward analysis) que en al menos 3 años no ha tenido 11 operaciones consecutivas perdidas con un riesgo beneficio de al menos 1:2 ó 1:2.5 en cada operación.

3-El EA debe generar como mínimo 6 operaciones semanales

Funcionamiento:

El EA funcionará como un Martin Gala parcial. Con un ciclo de máximo 15 operaciones.

- Cada operación es independiente con SL y take profit
- El usuario configurará el riesgo beneficio de la operativa (1:2 ó 1:2.5 o el que desee configurar)
- Solo tomará una operación a la vez
- Tomará como máximo dos operaciones por día (configurable por el usuario)
- El usuario configurará el ciclo de 15 operaciones, asignará el monto a arriesgar para cada operación (configurable por el usuario), desde la 1 hasta la 15. El EA calculará automáticamente el lotaje y el SL a utilizar para cumplir con el monto a arriesgar para cada operación.
- Luego de cerrar una operación ganadora, el EA reinicia el ciclo, y la próxima operación a tomar es la 1.
- El EA debe tener un botón de apagado/encendido para la operativa, otro botón para reiniciar el ciclo para que la próxima operación sea la número 1 y otro botón para activar o desactivar el mover SL a breakeven cuando una operación alcance el riesgo beneficio 1:1.5 (configurable)

En la descripción no puse condiciones de entrada para operar, tampoco mencioné indicadores. Las estrategias que tendrá el EA para detectar entradas serán a discreción del desarrollador, siempre y cuando cumpla con las 3 principales condiciones que puse al principio.

El EA deberá incluir como mínimo 5 estrategias de entrada distintas y estadísticamente poco correlacionadas entre sí, con el objetivo de diversificar la lógica operativa y reducir la probabilidad de secuencias largas de pérdidas bajo un mismo régimen de mercado.

No se desea un sistema basado en una sola condición optimizada ni múltiples variantes de una misma lógica disfrazadas como estrategias diferentes.

No se aceptará:

-únicamente cambiar parámetros de un mismo indicador,

- múltiples versiones de EMA crossover,
- ni variaciones menores de una misma estructura.

Por ejemplo, se busca combinar enfoques distintos como:

- trend following,
- momentum breakout,
- reversión,
- liquidity sweeps,
- estructuras chartistas,
- breakout de consolidaciones,
- volatilidad,
- smart money concepts,
- etc.

La finalidad es que el sistema pueda adaptarse mejor a diferentes condiciones de mercado:

- tendencia,
- lateralización,
- alta volatilidad,
- baja volatilidad,
- expansiones,
- compresiones,
- reduciendo dependencia de un único comportamiento del mercado.

El usuario solo se encargará de configurar la cantidad invertida por cada operación (la 1,2,3,4,5,6,7,8,9,10,11,12,13,14 y 15) y el EA (de acuerdo a las estrategias que coloques) se encargará de calcular el lotaje a utilizar de acuerdo al SL de la estrategia.

La tabla siguiente muestra un ejemplo de un ciclo, en este caso de 11 operaciones:

Trade #	Amount invested	Accumulated loss	Trade profit/loss	Expected profit (trade profit minus accumulated loss)
1	25	25	62.5	62.5
2	35	60	87.5	62.5
3	50	110	125	65
4	70	180	175	65
5	95	275	237.5	57.5
6	135	410	337.5	62.5
7	190	600	475	65
8	265	865	662.5	62.5
9	375	1240	937.5	72.5
10	530	1770	1325	85
11	740	2510	1850	80

EXPLICACIÓN MÁS EXTENSA DE LA TAREA TÉCNICA:

Objetivo general:

Desarrollar un Expert Advisor (EA) para MetaTrader 5 basado en un sistema de gestión de riesgo por ciclos de 15 operaciones independientes, utilizando múltiples estrategias de entrada adaptativas para operar principalmente Forex y XAUUSD (oro).

El objetivo principal NO es construir un sistema “infalible”, sino un sistema estadísticamente robusto que:

- minimice la probabilidad de alcanzar 11 pérdidas consecutivas,
- pueda mantenerse operativo durante largos periodos,
- genere múltiples ciclos positivos,
- y permita extracción constante de ganancias antes de un evento extremo.

=====

REQUISITOS PRINCIPALES

1. Toda operación debe tener un riesgo-beneficio mínimo configurable de:
 - 1:2
 - ó
 - 1:2.5
2. El sistema debe demostrar robustez estadística mediante:
 - backtesting mínimo de 3 años,
 - pruebas out-of-sample,
 - y preferiblemente Monte Carlo o walk-forward analysis.

El objetivo NO es garantizar que nunca ocurran 11 pérdidas consecutivas, sino minimizar estadísticamente esa probabilidad y evitar sobreoptimización.

3. El EA debe ejecutar como mínimo:
 - 6 operaciones semanales promedio.
4. El EA debe utilizar múltiples estrategias y lógicas de entrada distintas, NO una sola estrategia optimizada.

El objetivo es reducir dependencia de una única condición de mercado y disminuir correlación entre pérdidas consecutivas.

=====

FUNCIONAMIENTO DEL SISTEMA

El sistema funcionará como un “martingale parcial controlado”, utilizando ciclos de máximo 15 operaciones independientes.

IMPORTANTE:

- NO utilizar grids,
- NO utilizar averaging,
- NO acumular múltiples posiciones simultáneas,
- NO martingale tradicional.

Cada operación será completamente independiente y tendrá:

- su propio SL,
- su propio TP,
- y solo existirá UNA operación abierta a la vez.

Máximo:

- 2 operaciones por día.

=====

LÓGICA DEL CICLO

El usuario configurará:

- el monto máximo a arriesgar en cada una de las 15 operaciones del ciclo.

Ejemplo:

Operación	1	→	riesgo	\$25
Operación	2	→	riesgo	\$35
Operación	3	→	riesgo	\$50

...

Operación 11 → riesgo \$740

El EA deberá:

- calcular automáticamente el lotaje,
- calcular automáticamente el SL,
- ajustar el tamaño de posición,
- respetar exactamente el monto máximo de pérdida definido para cada operación.

=====

RESET DEL CICLO

Cuando una operación gane:

- recuperará las pérdidas acumuladas anteriores del ciclo,
- dejará beneficio neto,
- y el sistema hará RESET del ciclo.

RESET significa:

- volver nuevamente a la operación número 1,
- utilizando nuevamente el menor riesgo configurado.

Ejemplo práctico:

Si:

- operación 1 pierde,
- operación 2 pierde,
- operación 3 pierde,
- operación 4 gana,

entonces:

- las pérdidas acumuladas se recuperan,
- el ciclo queda en profit,
- y la siguiente operación vuelve a ser la operación número 1.

=====

EXTRACCIÓN DE GANANCIAS

La filosofía del sistema consiste en:

- retirar periódicamente las ganancias generadas,
- dejando principalmente el capital operativo inicial dentro de la cuenta.

El objetivo es que:

- incluso si eventualmente ocurre un ciclo completo negativo,
- gran parte de las ganancias acumuladas previamente ya estén protegidas fuera de la cuenta.

=====

FILOSOFÍA ESTADÍSTICA

El sistema NO necesita un win rate extremadamente alto para ser rentable.

La lógica matemática está basada en:

- múltiples ciclos positivos,

- recuperación de pérdidas acumuladas mediante una sola operación ganadora,
- y reducción estadística de secuencias extremas.

Ejemplo conceptual:

Si el sistema tuviera hipotéticamente:

- 35%-45% de win rate,
- RR 1:2 o 1:2.5,
- múltiples estrategias no correlacionadas,

la probabilidad de alcanzar 11 pérdidas consecutivas disminuye considerablemente frente a un sistema basado en una sola estrategia.

El objetivo del proyecto NO es eliminar completamente el riesgo, sino:

- maximizar robustez,
- supervivencia estadística,
- adaptabilidad,
- y extracción constante de capital.

=====

ESTRATEGIAS DEL EA

Las estrategias específicas de entrada quedan a discreción del desarrollador.

Sin embargo, el EA DEBE utilizar múltiples enfoques distintos, por ejemplo:

- trend following,
- momentum breakout,
- reversión,
- liquidity sweeps,
- estructuras chartistas,
- smart money concepts,
- volatilidad,
- breakout de consolidaciones, etc.

NO se desea un EA basado únicamente en:

- un solo indicador,
- una sola lógica,
- ni una sola condición optimizada.

El objetivo es:

- adaptabilidad a diferentes condiciones de mercado,
- reducción de monotonía,
- y disminución de correlación entre pérdidas consecutivas.

=====

FUNCIONES DEL EA

El EA debe incluir:

1. Botón ON/OFF para activar o desactivar operativa.
 2. Botón RESET para reiniciar manualmente el ciclo y volver a la operación número 1.
 3. Configuración editable para:
 - RR,
 - montos de riesgo por operación,
 - máximo de operaciones diarias,
 - horarios,
 - filtros,
 - etc.
 4. Registro visual/log de:
 - operación actual del ciclo,
 - pérdidas acumuladas,
 - profit acumulado,
 - estrategia utilizada,
 - win rate,
 - drawdown,
 - estadísticas relevantes.
-

TABLA DE EJEMPLO DE CICLO (EN ESTE EJEMPLO SON 11)

Trade #	Amount invested	Accumulated loss	Trade profit/loss	Expected profit (trade profit minus accumulated loss)
1	25	25	62.5	62.5
2	35	60	87.5	62.5
3	50	110	125	65
4	70	180	175	65
5	95	275	237.5	57.5
6	135	410	337.5	62.5
7	190	600	475	65
8	265	865	662.5	62.5
9	375	1240	937.5	72.5
10	530	1770	1325	85
11	740	2510	1850	80

La tabla muestra un ejemplo conceptual de cómo:

- una sola operación ganadora dentro del ciclo
- recupera pérdidas acumuladas
- y deja profit neto.