

CNW

Quantitative Research

Seis empresas, dos años de prueba

Informe de resultados — NASDAQ-6
Período: Mayo 2024 - Mayo 2026

¿Qué pasó? La prueba

Durante dos años pusimos a prueba un robot que compra y vende acciones automáticamente en seis empresas grandes de tecnología.

El resultado simple: Si hubieras invertido dinero y esperado sin hacer nada, ganabas **+15.1%**. Con el robot, ganabas **+28.4%**. Es casi el doble.

Además, los momentos malos fueron menos malos. La peor caída fue de **-30.1%** con el robot versus **-38.6%** sin él. Menos sufrimiento, mismo dinero.

NASDAQ-6 Backtest (May 2024 - May 2026) | Activación dinámica del modelo
 Optimizado: +28.4% Buy&Hold: +15.1% Outperf: +13.3% Sharpe opt/BH: 0.86/0.40

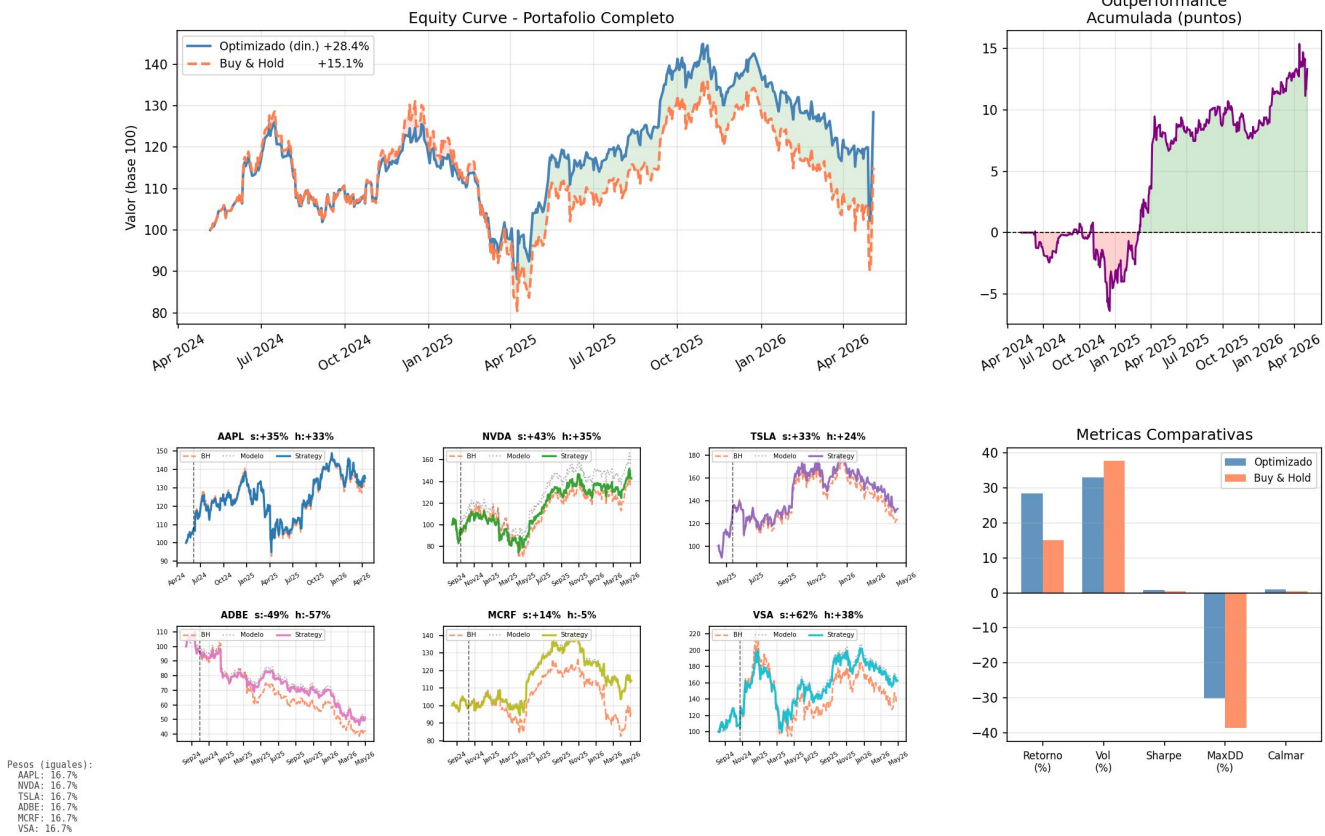


Figure 1: Figura 1. Arriba: el dinero creciendo. Línea azul = con robot. Línea naranja = sin hacer nada. Abajo: cada empresa por separado.

¿Cómo funciona el robot?

El robot tiene dos partes que trabajan juntas:

Parte 1: El cerebro (la red neuronal)

Es como un cerebro artificial que aprende de los datos históricos de cada empresa. Mira 2-3 años de precios pasados y aprende a predecir cuándo es buen momento de comprar o vender.

¿Qué mira? Cosas como: el precio, cuánto sube y baja, cuánta gente compra y vende, si está caro o barato ahora comparado con antes.

¿Qué decide? Cada día: “compra”, “vende”, o “espera”.

Importante: Cada empresa tiene su propio cerebro. Apple tiene uno diferente a Tesla. Porque Apple sube lentamente y Tesla da saltos enormes. El cerebro se adapta a cómo se comporta cada una.

Parte 2: El filtro (Guard)

Es un supervisión que revisa las decisiones del cerebro.

¿Qué hace? Dos cosas:

Primero: mira si hay pánico en el mercado (mucha volatilidad). Si la hay, le dice al cerebro “espera, no hagas nada ahora”. Cuando el mercado está tranquilo, deja que el cerebro trabaje.

Segundo: chequea que la tendencia sea real. Si el cerebro dice “vende” pero la empresa sigue subiendo de verdad, el filtro dice “no, mantén”. Si dice “compra” pero sigue bajando, dice “sale”.

¿Por qué existe? Para que el robot gane cuando acierta y pierda menos cuando se equivoca.

Guard Agresivo vs Conservador

El cerebro es uno solo. Lo que cambia es el filtro:

Guard Agresivo: Rápido. Si el cerebro decide, ejecuta casi ya. Lo usamos en cinco empresas (AAPL, NVDA, TSLA, ADBE, MCRF).

Guard Conservador: Lento. Espera confirmación extra. Lo usamos en VSA porque VSA sube y baja constantemente, y un Guard rápido entraría y saldría mil veces.

¿Qué pasó en cada empresa?

Empresa	Inicio	Con robot	Sin robot	Diferencia
AAPL	Jun 24	+35.3%	+32.9%	+2.4
NVDA	Sep 24	+42.7%	+34.8%	+7.9
TSLA	May 25	+32.8%	+23.7%	+9.1
ADBE	Sep 24	-49.2%	-57.5%	+8.3
MCRF	Oct 24	+14.2%	-4.6%	+18.8
VSA	Oct 24	+62.5%	+38.1%	+24.4

Table 1: Cuánto ganó o perdió desde que empezó hasta Mayo 2026.

Adobe: la que perdió dinero

Adobe fue la única que perdió dinero: **-49.2%**. Casi la mitad.

¿Por qué? Porque Adobe tuvo problemas de verdad. Competencia nueva, clientes molestos. El robot no puede arreglarlo.

Pero mira el número: sin el robot, habrías perdido **-57.5%**. Con el robot, **-49.2%**. El robot te ahorró **+8.3 puntos**. Cuando Adobe estaba cayendo, el robot salió antes. No recuperó nada, pero protegió capital.

Las que ganaron mucho

VSA +24.4: El robot evitó la caída de finales 2024 y volvió a entrar antes de la subida de 2025. Capturó el movimiento sin el pánico.

MCRF +18.8: Sin robot habrías perdido dinero. Con robot ganaste. El robot encontró los momentos correctos.

TSLA +9.1: El robot salió antes de la caída de Octubre 2024 y volvió antes de la subida de Mayo 2025.

Las gráficas de cada empresa

R_ATR_HA_GUARD — AAPL

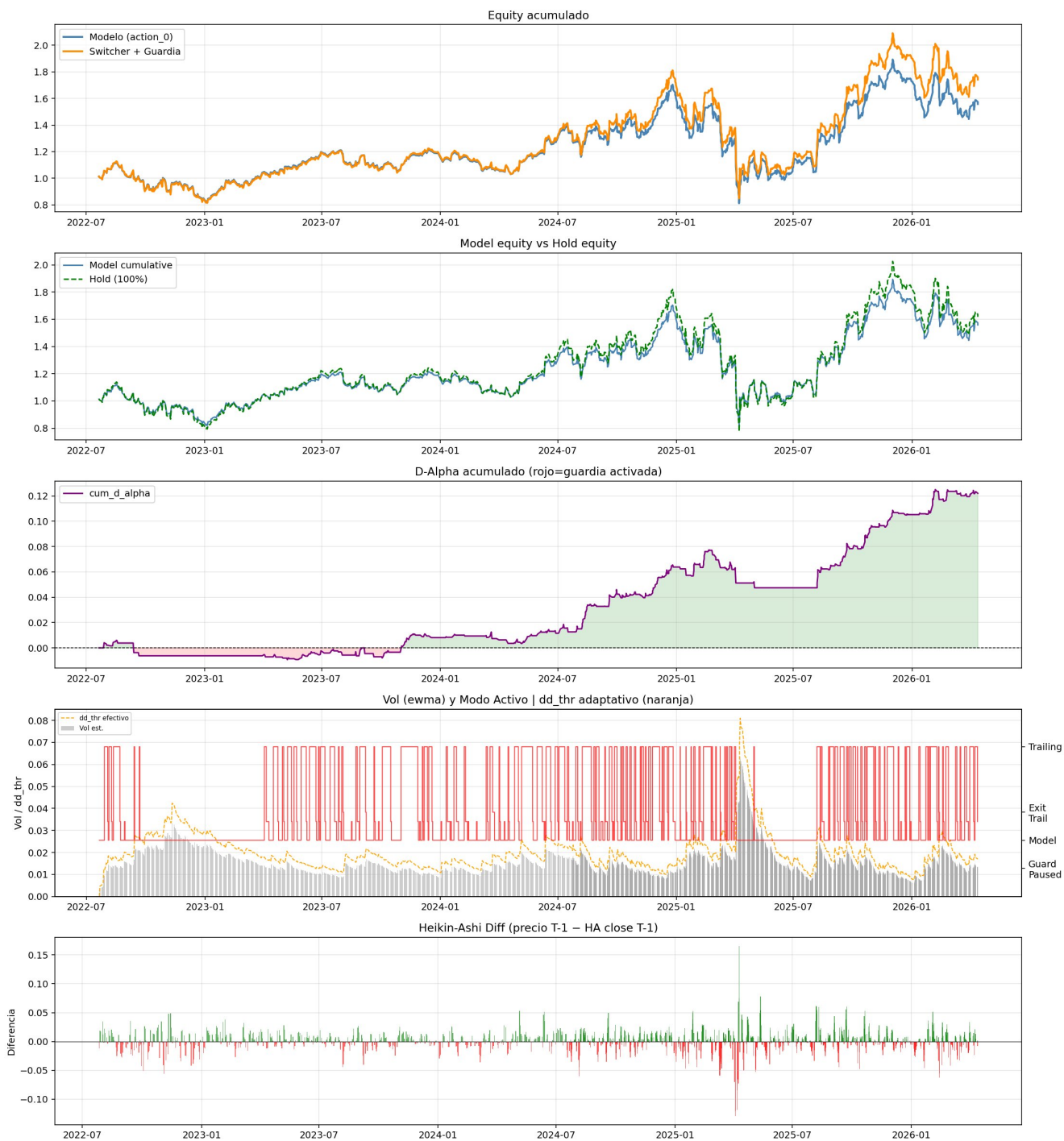


Figure 2: AAPL: Ganancia pequeña pero consistente.

R_ATR_HA_GUARD -- NVDA [aggressive]

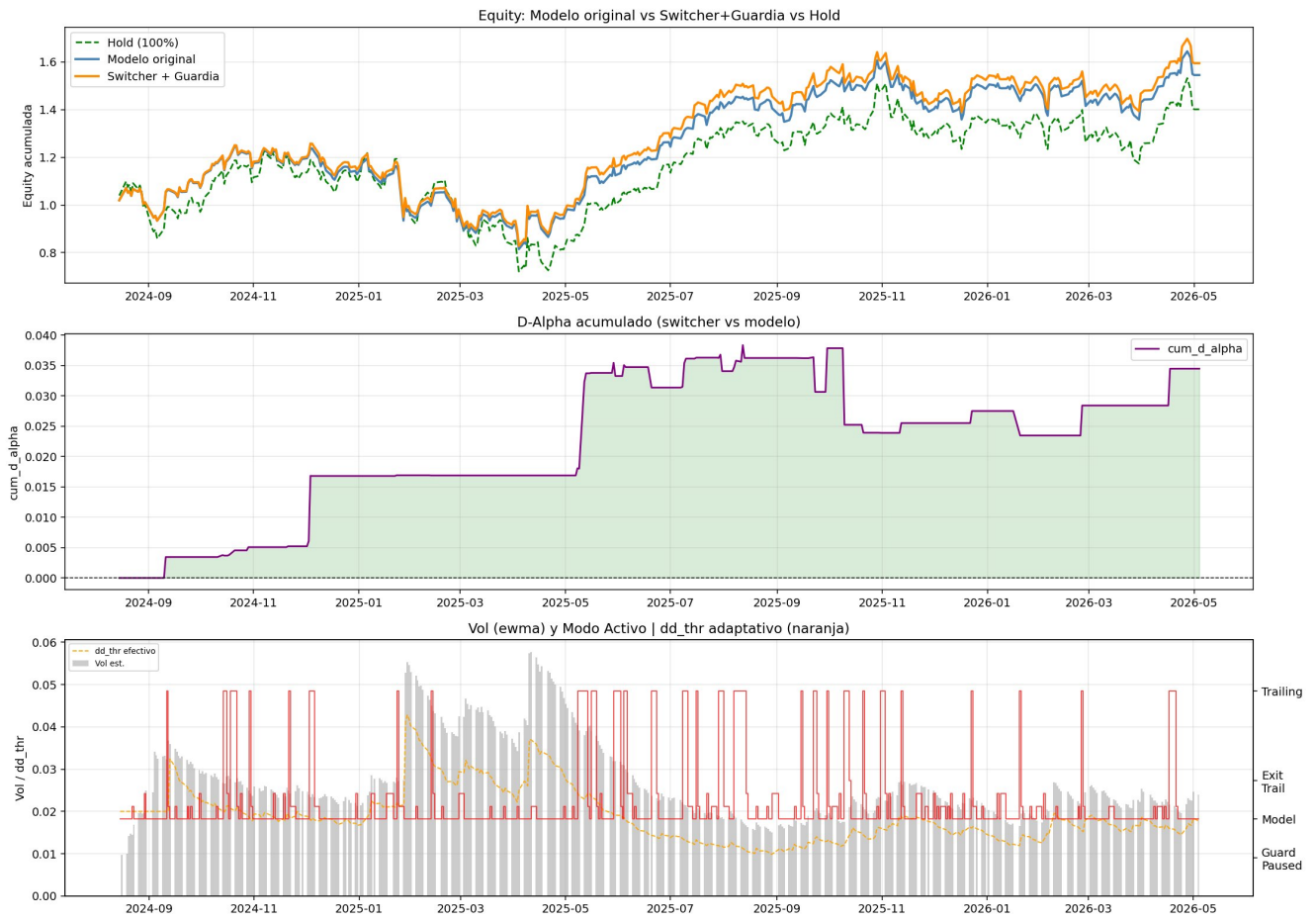


Figure 3: NVDA: El robot reaccionó rápido a cada movimiento.

R_ATR_HA_GUARD -- TSLA [aggressive]

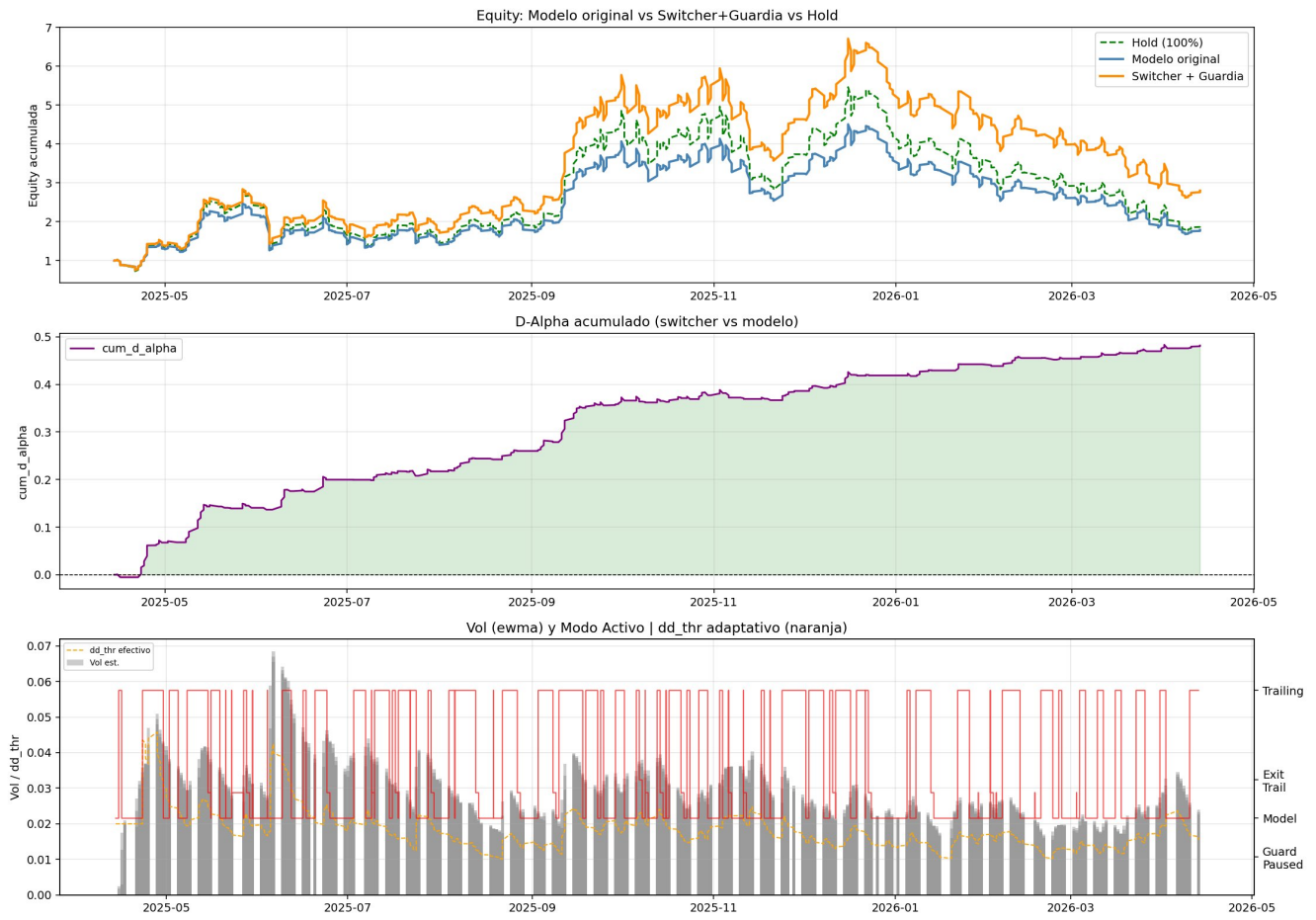


Figure 4: TSLA: Salió en Octubre, volvió en Mayo. Capturó todo.

R_ATR_HA_GUARD -- ADBE [aggressive]

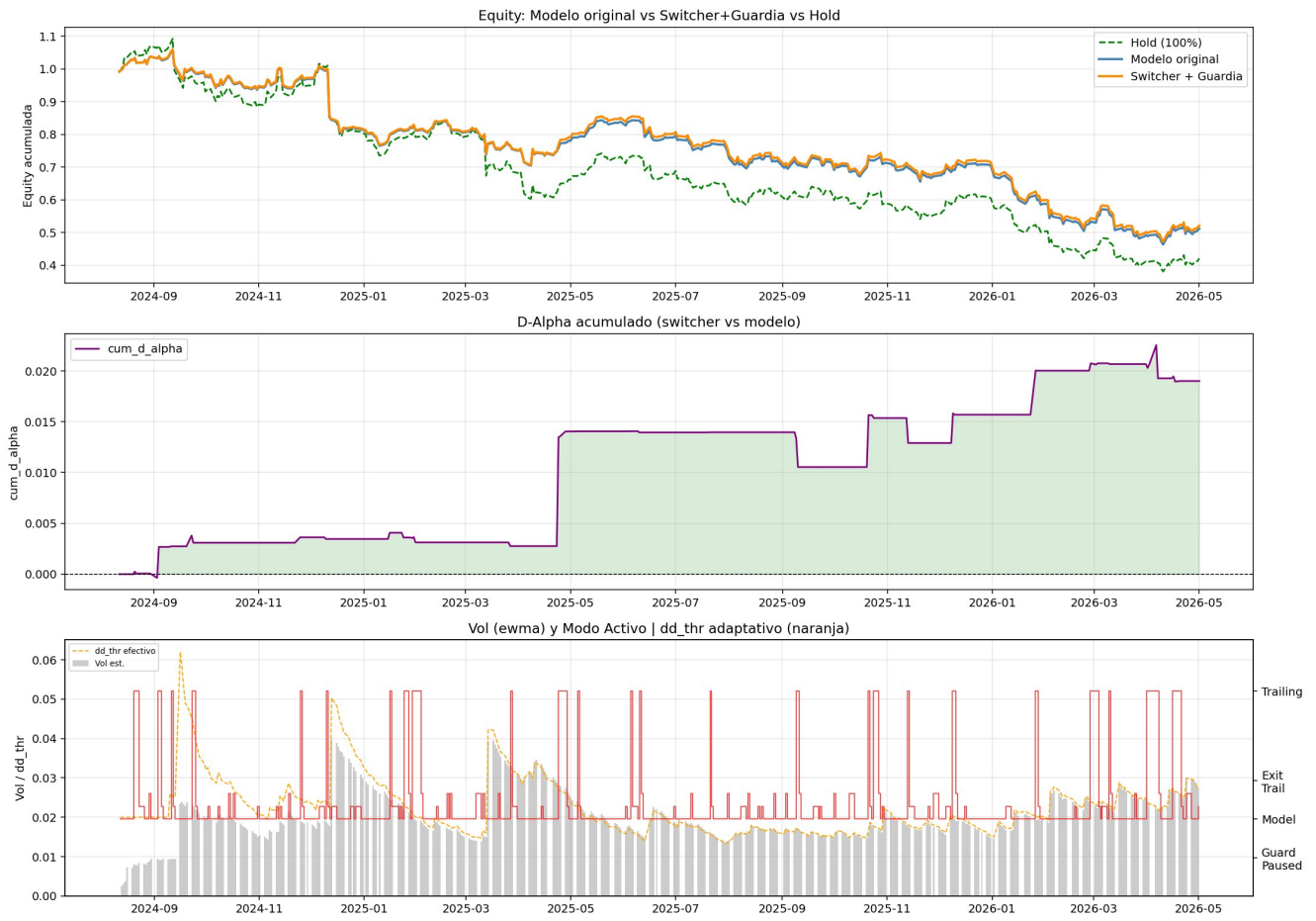


Figure 5: ADBE: Cayó mucho, pero el robot redujo la pérdida.

R_ATR_HA_GUARD -- MCRF [aggressive]

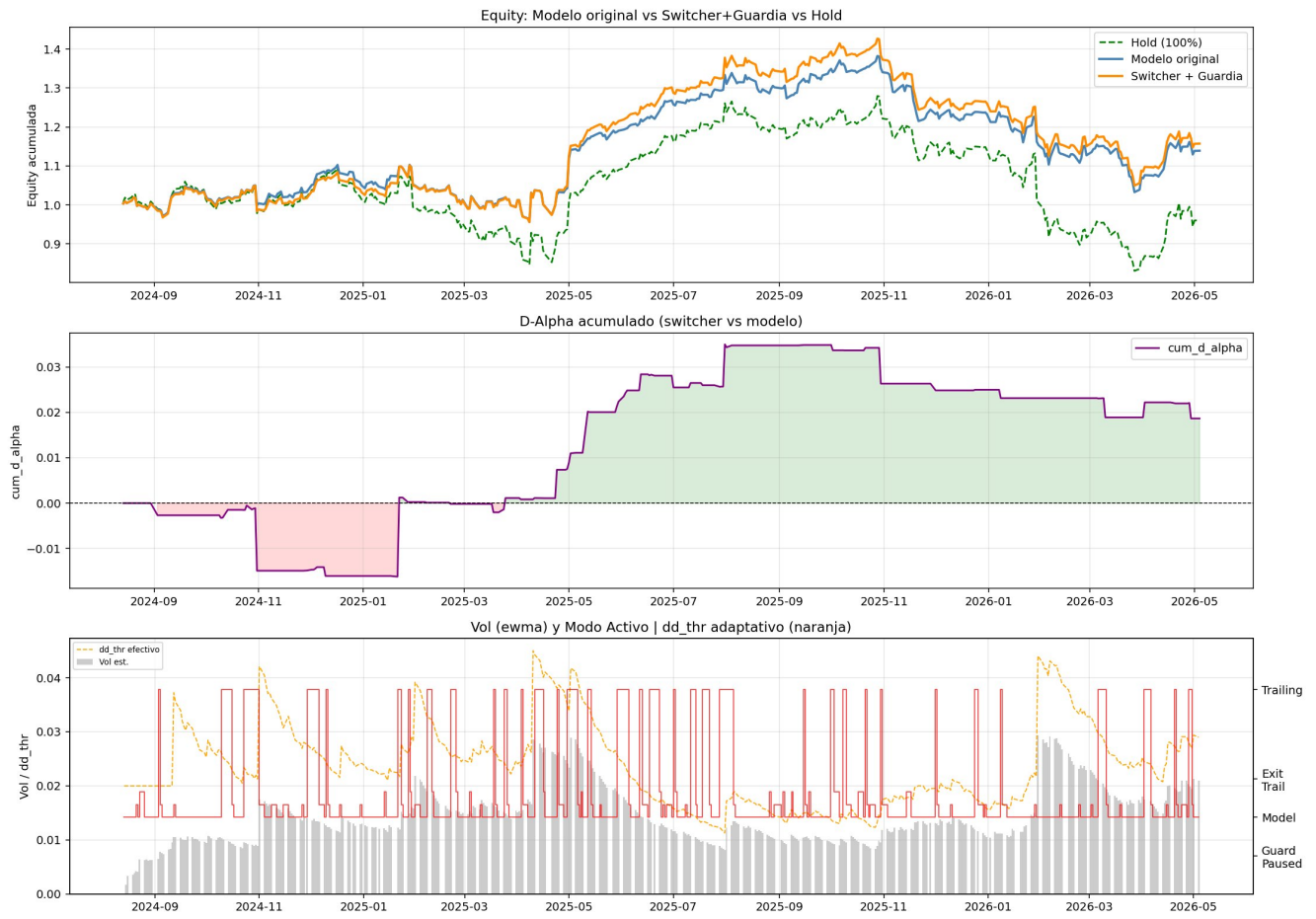


Figure 6: MCRF: Transformó una pérdida en ganancia.

R_ATR_HA_GUARD -- VSA [aggressive]

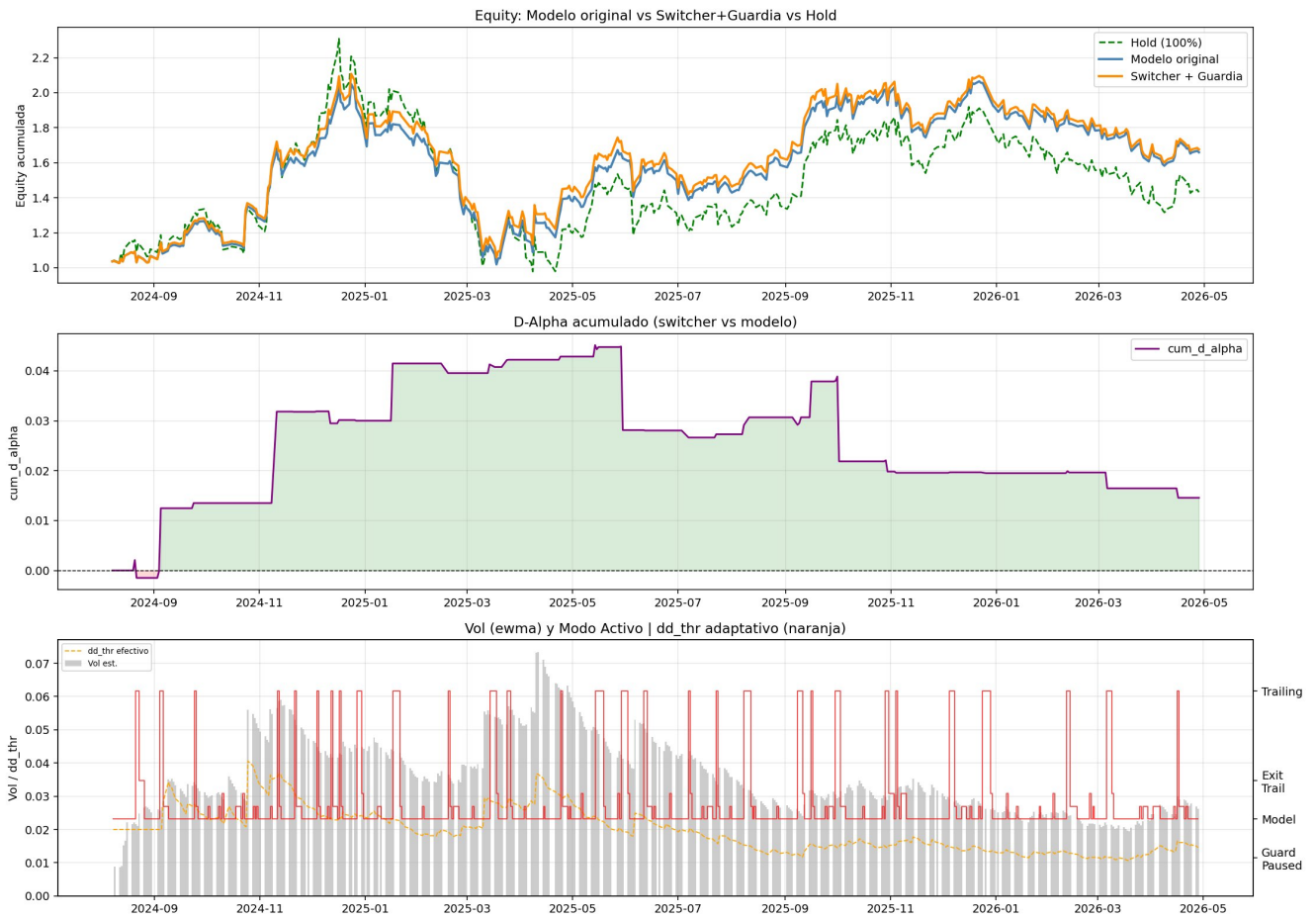


Figure 7: VSA: La mejor. Guard conservador funcionó perfecto.

Lo que estos números NO incluyen

Costos reales

El dinero ganado en el paper no resta:

- **Comisiones por comprar/vender:** Cada vez que el robot compra o vende, paga una pequeña comisión.
- **Spread:** La diferencia entre lo que pagas por comprar y lo que recibes por vender.
- **Deslizamiento:** Si vendes rápido, el precio baja un poco antes de ejecutar.

En total, probablemente pierdes entre 0.5% y 1.5% en costos. Así que la ganancia real sería **+11.5 a +12.5%** en lugar de **+13.3%**. Todavía casi el doble que no hacer nada.

¿Por qué cada empresa tiene su propio cerebro?

Porque se comportan diferente:

Apple: Sube lentamente, pocas correcciones. El cerebro aprende a ser paciente.

Tesla: Sube rápido, cae rápido. El cerebro aprende a reaccionar rápido.

NVIDIA: Movimientos enormes. El cerebro aprende ciclos especiales.

Si usaras el cerebro de Tesla en Apple, daría órdenes constantemente cuando Apple no las necesita. No funciona.

¿Se puede usar este robot en otras empresas?

La respuesta es complicada:

Si tomas la estructura del cerebro de Tesla y lo entrenas de cero con el histórico de otra empresa (no usas los valores aprendidos, entrenas nuevo), algunas empresas funcionarían bien. Otras no.

¿En cuántas? Pocas. Algunas con comportamiento similar funcionarían. Otras que estadísticamente son similares aunque no lo parezcan, también. Pero la mayoría no.

No sabemos cuáles hasta que las probemos. Por eso no lo hicimos: hubiera requerido mucho poder de computadora.

Generación 2.0: lo que viene

Ahora estamos trabajando en una versión mejorada con más datos y mejor estructura. Pero no está lista aún.

¿Funciona de verdad?

Estos números muestran que **en el pasado** el robot funcionó.

Pero el pasado no garantiza el futuro.

Lo importante es: desde Mayo 2026, el robot está operando con datos nuevos que nunca ha visto. Si sigue ganando, sabremos que fue de verdad. Si pierde, lo diremos sin esconder nada.

Eso es lo que importa ahora: probar que no fue suerte.