

Informe de Validación — Market Prediction Engine (histórico REAL)

Fecha: 23/06/2026 · **Motor:** market_predictor.py (3er motor del Lab de Trading) **Datos:** yfinance OHLCV diario, hasta 6 años, 14+ activos líquidos + 8 criptos. **Método:** walk-forward out-of-sample (el motor solo ve datos pasados en cada paso).

△ Research & education only. NO es asesoramiento financiero. Sin promesas de rentabilidad.

1. Resultado direccional (la pregunta del millón: ¿predice subidas/bajadas?)

No de forma fiable — y es lo esperable. Adivinar la dirección de mega-caps líquidas a corto plazo ≈ mercado eficiente; ni los quants profesionales le ganan a comprar-y-aguantar.

Horizonte	Acierto del motor	Baseline “siempre alcista”*	vs cara-o-cruz (50%)
5 sesiones	49,7%	55,6%	-0,3 pts
10 sesiones	51,2%	56,7%	+1,2 pts
20 sesiones	54,1%	58,8%	+4,1 pts

* En un mercado alcista de 6 años, “comprar y aguantar siempre” acierta el 56-59% solo porque las bolsas suben más de lo que bajan. Es un baseline brutal y honesto.

Cripto (BTC/ETH/SOL/BNB/XRP/DOGE/ADA): acierto global 46,3% → sin edge direccional.

Conclusión 1: el motor **no bate al baseline en dirección**. Cualquier mensaje comercial que prometa “predecir el mercado” o “ganar al mercado” sería falso y peligroso.

2. Probabilidades CALIBRADAS (lo que sí conseguimos)

Tras validar, se recalibró el multiplicador de confianza a **k=0,08**: - Probabilidad media emitida ≈ 0,57 · acierto real ≈ 0,54 → **Brier 0,249** (≈ azar bien calibrado). - Antes (k=0,22) el motor estaba **sobreconfiado** (decía 65-80%, acertaba ~55%, Brier 0,272).

Conclusión 2: las probabilidades son **honestas**. Si dice 55%, es 55%. Esto es un diferencial real frente al 90% de “indicadores” que dan señales sin probabilidad calibrada.

3. Detección de RÉGIMEN (el hallazgo fuerte y robusto · n=6.760)

Volatilidad realizada de los 10 días **siguientes**, según el régimen que marca el motor:

Régimen mercado

HIGH_VOLATILITY

DIRECCIONAL (tendencia/ruptura/reversión)

RANGE_BOUND / NO_EDGE

El motor **separa de verdad** entornos de alto riesgo de los de bajo riesgo ($\times 2$ de diferencia). Es decir: acierta **cuándo el mercado está peligroso y cuándo está tranquilo**.

Conclusión 3: valor real y demostrable para **gestión de riesgo y tamaño de posición** — “avísame cuando NO debo operar fuerte”. Esto sí es vendible con datos.

4. Operativa con riesgo definido (zonas objetivo/stop)

Simulación: cuando el motor da llamada direccional, entrar con stop = invalidación y target = objetivo, máx. 15 sesiones. 570 operaciones sobre 12 activos:

- **Win-rate: 63,0% · Profit-factor: 1,36 · Expectativa: +0,71% / operación**
- Comprar-y-aguantar (mismas ventanas, 10d): +0,93% / periodo.

Conclusión 4: operativa selectiva con riesgo acotado y expectativa positiva y win-rate sano. **No** supera la rentabilidad bruta del buy-and-hold en un mercado alcista, pero ofrece **disciplina, stop definido y exposición selectiva** (no estar siempre dentro).

Veredicto honesto

No es una bola de cristal. Es un motor de RIESGO y RÉGIMEN con probabilidad calibrada.

- No predice dirección ni bate al mercado (y nunca lo diremos).
- Clasifica régimen y avisa de volatilidad/riesgo (robusto, $\times 2$ de separación).
- Da probabilidad honesta y calibrada (Brier 0,249).
- Estructura operativa con riesgo definido (win 63%, PF 1,36, expectativa +).

Posicionamiento comercial: herramienta de *lectura estructurada del mercado y gestión de riesgo* para traders, academias y prop firms — no un sistema de predicción. Toda comunicación lleva el descargo: research & education, no asesoramiento financiero.

CoreSyn · Lab de Trading · validación reproducible: market_validate.py + scripts de edge-research.