

Informe de Riesgos. Monitorización y cambio de régimen (FX)

Fecha y hora: 2026-02-26 09:08:41 (GMT+01:00)

Régimen del día: A		Criterio aplicado: Condiciones normales → C=0, B=2				
Bloque	Indicador	Dato de hoy	Umbral Normal (A)	Alerta Estrés (B)	Estrés Severo (C)	Régimen
Volatilidad	VIX	19.6	< 20	20–30	> 30	A
Volatilidad	Vol realizada 20d (EURUSD/AUDUSD) vs percentiles	EURUSD: 5.63% (P42) ; AUDUSD: 10.41% (P89)	< P75	P75–P90	> P90	B
Liquidez	Spread bid-ask proxy (Corwin–Schultz) z-score (EURUSD/AUDUSD/USDJPY)	EURUSD z=-0.83 AUDUSD z=-0.84 USDJPY z=0.11	< 2	2–3	> 3	A
Liquidez	Gaps diarios (>3×ATR14) (EURUSD/AUDUSD/USDJPY)	breaches=0 ; max=0.03×ATR	No	Aislados	Recurrentes	A
USD stress	USD funding proxy (SOFR - TBill3M) [bps]	7.0 bp	< 25	25–50	> 50	A
USD stress	SOFR–EFFR [bps]	3.0 bp	< 30	30–60	> 60	A
Refugio	CHFJPY (48h)	0.37%	< +2%	+2% a +4%	> +4%	A
Refugio	AUDJPY & NZDJPY (48h) media	AUDJPY=0.96% ; NZDJPY=0.64% ; mean=0.80%	> -3%	-3% a -6%	< -6%	A
Crédito	HY OAS (US + EU) [bps] (peor de ambos)	297 bp (US=297; EU=265)	< 450	450–600	> 600	A
Crédito	Índice soberano (proxy) [bps] (media spreads 10Y vs DE)	IT-DE=68.5bp ; ES-DE=46.3bp ; FR-DE=72.3bp ; avg=62.4bp	Estables	+50–75	> 100	B
Commodities	WTI/Brent (10 días) (peor caída)	WTI=4.06% ; Brent=1.00% ; worst=1.00%	< -15%	-15% a -30%	< -30%	A
Eventos	Decisión inesperada / emergencia	No	No	—	Sí	A

Determinación del régimen del día

Resultado del análisis: Régimen A

Criterio aplicado:

- Régimen C solo si: C >= 3, o C >= 2 y B >= 2
- Régimen B solo si: C >= 1 y B >= 2, o B >= 3
- En cualquier otro caso: Régimen A

Ajuste operativo automático

Régimen	Exposición	Direccionalidad	Acción
A	Normal	Bidireccional	Operativa completa
B	Reducida	Sesgo defensivo	Limitar BUY risk-on
C	Mínima / Cero	Unidireccional	Kill switch / cierre

Nota de control: Esta checklist tiene carácter preventivo y no predictivo. Su finalidad es identificar cambios de régimen y ajustar la operativa, no anticipar movimientos de mercado.

Análisis de tendencia, sentido y fuerza de los diferentes Timeframes

5 Minutos					15 Minutos					1H				
ACTIVO	TENDENCIA	DIR	ADX	ATR	ACTIVO	TENDENCIA	DIR	ADX	ATR	ACTIVO	TENDENCIA	DIR	ADX	ATR
AUDCAD	MEDIA	▼ BEAR	31.2	NORMA	AUDCAD	DEBIL	▼ BEAR	18.4	NORMAL	AUDCAD	MEDIA	▲ BULL	25.7	NORMAL
AUDNZD	DEBIL	▼ BEAR	13.1	NORMA	AUDNZD	DEBIL	▲ BULL	14.1	NORMAL	AUDNZD	MEDIA	▲ BULL	21.4	NORMAL
AUDUSD	MEDIA	▼ BEAR	23.4	NORMA	AUDUSD	DEBIL	▼ BEAR	17.8	NORMAL	AUDUSD	MEDIA	▲ BULL	28.2	NORMAL
CADCHF	DEBIL	▲ BULL	12.5	NORMA	CADCHF	DEBIL	▲ BULL	17.6	NORMAL	CADCHF	MEDIA	▼ BEAR	23	NORMAL
EURCHF	MEDIA	▼ BEAR	33.7	EXPAND	EURCHF	DEBIL	▼ BEAR	14.8	NORMAL	EURCHF	DEBIL	▼ BEAR	15.4	NORMAL
EURGBP	DEBIL	▲ BULL	16.9	NORMA	EURGBP	DEBIL	▲ BULL	18.3	NORMAL	EURGBP	DEBIL	▲ BULL	13.7	NORMAL
EURUSD	DEBIL	▼ BEAR	19	NORMA	EURUSD	MEDIA	▼ BEAR	20.2	NORMAL	EURUSD	MEDIA	▲ BULL	27.8	NORMAL
NZDCAD	MEDIA	▼ BEAR	31	NORMA	NZDCAD	MEDIA	▼ BEAR	21.2	NORMAL	NZDCAD	MEDIA	▲ BULL	24.9	NORMAL
NZDUSD	MEDIA	▼ BEAR	21.8	NORMA	NZDUSD	MEDIA	▼ BEAR	21.2	NORMAL	NZDUSD	MEDIA	▲ BULL	25.2	NORMAL
USDCAD	DEBIL	▲ BULL	16.5	NORMA	USDCAD	DEBIL	▲ BULL	14	NORMAL	USDCAD	MEDIA	▼ BEAR	34.9	NORMAL
TF: 5					TF: 15					TF: 60				

Eventos económicos de alto impacto (★★★) del día Hora GMT

Hora	Moneda	País	Evento
13:30	USD	EE.UU.	Unemployment Claims

Conclusiones

El mercado esta volvinedo a la operacion normal. Dado que todavia no hay una estabilidad total, vigilamos las posiciones abiertas e intemos cerrar dichas posisicones antes de conseguir el TP espemás activa de lo habitual y de lo deseado.

Al momento de elaborar este informe tenemos una posición abierta en el AUDCAD, la cual se abrio ayer y donde el Swap nos perjudica, al ser muy contrario a nuestros interes. Esto nos llevará a cerrar, si es posible, esta posición donde el dia de hoy, ante sde que salte un nuevo swap.

Consideramos que la posición debio ser cerrada de tocar el TP previsto. Pero no lo hicimos y al momento de ahora ha perdido la estructura de cierre buscada, por lo que debe ser tratada como una posición fallida. Fue abierta en 0.97188. Mantinene una estructura bajista en 5M, pero presenta dos resistencias en 0.97330 y 0.97460. A su vez presenta dos soportes en 0.97220 y 0.97220. En consecuencia si la posicion toca 0.97130, se valorará un cierre total o parcula, tomando parte del beneficio. Si recuperra el 0.97460, se invalidaria el escenario bajista y procederemos a cerrar la posición por complet.

En el día de hoy no hay eventos de relevancia, que nos indiquen que debemos actual. A la vez hemos recuperado el régimen A, que nos permite operar discrecionalmente

Elaborado

Revisado



Hora: _____

Hora: _____