

Fecha y hora: 2026-03-02 09:46:01 (GMT+01:00)

Bloque	Indicador	Dato de hoy	Umbral Normal (A)	Alerta Estrés (B)	Estrés Severo (C)	Régimen
Volatilidad	VIX	18.6	< 20	20–30	> 30	A
Volatilidad	Vol realizada 20d (EURUSD/AUDUSD) vs percentiles	EURUSD: 5.21% (P33) ; AUDUSD: 9.78% (P82)	< P75	P75–P90	> P90	B
Liquidez	Spread bid-ask proxy (Corwin–Schultz) z-score (EURUSD/AUDUSD/USDJPY)	EURUSD z=-0.84 AUDUSD z=-0.90 USDJPY z=-0.78	< 2	2–3	> 3	A
Liquidez	Gaps diarios (>3×ATR14) (EURUSD/AUDUSD/USDJPY)	breaches=0 ; max=1.10×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)	0.61%	< +2%	+2% a +4%	> +4%	A
Refugio	AUDJPY & NZDJPY (48h) media	AUDJPY=0.10% ; NZDJPY=0.03% ; mean=0.07%	> -3%	-3% a -6%	< -6%	A
Crédito	HY OAS (US + EU) [bps] (peor de ambos)	298 bp (US=298; EU=264)	< 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	Sí	No	—	Sí	C

Resultado del análisis: **Régimen B**

- Régimen C solo si: $C \geq 3$, o $C \geq 2$ y $B \geq 2$
- Régimen B solo si: $C \geq 1$ y $B \geq 2$, o $B \geq 3$
- 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	▲ BULL	42.2	NORMAL	AUDCAD	MEDIA	▼ BEAR	29.5	NORMAL	AUDCAD	MEDIA	▼ BEAR	34.6	NORMAL
AUDNZD	MEDIA	▲ BULL	21.8	NORMAL	AUDNZD	DEBIL	▲ BULL	17.8	NORMAL	AUDNZD	MEDIA	▼ BEAR	26.3	NORMAL
AUDUSD	MEDIA	▲ BULL	39.9	NORMAL	AUDUSD	MEDIA	▼ BEAR	31.3	NORMAL	AUDUSD	MEDIA	▼ BEAR	27.1	NORMAL
CADCHF	MEDIA	▲ BULL	46.2	NORMAL	CADCHF	MEDIA	▲ BULL	35.8	NORMAL	CADCHF	MEDIA	▲ BULL	25	NORMAL
EURCHF	MEDIA	▲ BULL	34.7	NORMAL	EURCHF	DEBIL	▲ BULL	19.4	NORMAL	EURCHF	MEDIA	▼ BEAR	37.3	NORMAL
EURGBP	MEDIA	▲ BULL	22.6	NORMAL	EURGBP	DEBIL	▲ BULL	17.4	NORMAL	EURGBP	MEDIA	▲ BULL	33.6	NORMAL
EURUSD	MEDIA	▼ BEAR	49.2	NORMAL	EURUSD	MEDIA	▼ BEAR	42.9	NORMAL	EURUSD	MEDIA	▼ BEAR	27.5	NORMAL
NZDCAD	MEDIA	▲ BULL	48.8	NORMAL	NZDCAD	MEDIA	▼ BEAR	36.3	NORMAL	NZDCAD	MEDIA	▼ BEAR	29.8	NORMAL
NZDUSD	MEDIA	▼ BEAR	47.6	NORMAL	NZDUSD	MEDIA	▼ BEAR	37.4	NORMAL	NZDUSD	MEDIA	▼ BEAR	26	NORMAL
USDCAD	MEDIA	▲ BULL	23.8	NORMAL	USDCAD	MEDIA	▲ BULL	22	NORMAL	USDCAD	DEBIL	▲ BULL	17.9	NORMAL
TF: 5					TF: 15					TF: 60				

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

Hora	Moneda	País	Evento
04:00	JPY	Japón	BOJ Gov Ueda Speaks
15:00	USD	EE.UU.	ISM Manufacturing PMI
21:10	AUD	Australia	RBA Gov Bullock Speaks

Conclusiones

A pesar del ataque a Iran del fin de semana y la creciente inestabilidad en la zona, que influye directamente en la economia mediante la subida abrupta del precio dle barril, tanto el Brent como el WTI, los parametros de riesgo no se han visto influidos de manera intensa.

Hasta la elaboración del informe, el sistema de copia ha permanecido cerrado, con el proposito de medir si el evento manifestaba tendencia en el mopvimiento de nuestros activos.

La apertura de Sidney se manifesto con una disrupción total del precio de cierre del viernes, pero esa disrupción se fue corrigiendo en la mayoria de los pares rapidamente.

Esta mañana y coincidiendo con la apertura de las sesiones europeas la cuenta espejo ha abierto dos posiciones, una de las culaes se ha cerrado, con benefico completo, en aprox. 1h 15 horas. Este comportamiento, junto con los parametros demedición de la tendencia nos lleva a determinar la puesta en marcha del sistema

Elaborado

Revisado



Hora: _____

Hora: _____