

GLOSARIO

5.7 DESARROLLO DE NUESTRO SISTEMA – OPTIMIZACIÓN I

Función objetivo: En la optimización de un sistema de trading, la función objetivo es el criterio que se utiliza para evaluar el rendimiento de un sistema de trading. Esta función cuantifica lo bien que un sistema de trading alcanza sus objetivos, como maximizar los rendimientos, minimizar el riesgo, mejorar la relación de Sharpe, etc. La función objetivo es fundamental en el proceso de optimización, ya que guía la selección de los mejores parámetros o configuraciones del sistema.

Mapa de optimización: Un mapa de optimización, también conocido como superficie de respuesta de optimización, es una representación visual que muestra cómo cambia el valor de la función objetivo en respuesta a diferentes combinaciones de parámetros del sistema de trading.

Operativa Live: Operativa en mercado real.

Restricciones: Las restricciones en la optimización de un sistema de trading son limitaciones o condiciones que se aplican al proceso de optimización. Pueden incluir factores como límites en el nivel de riesgo, restricciones de capital, límites en el número máximo de operaciones, entre otros.

Sets: Cuando hablamos de Set nos referimos a una combinación concreta de inputs para un sistema obtenida de una optimización.