

GLOSARIO

5.7 DESARROLLO DE NUESTRO SISTEMA – OPTIMIZACIÓN II

Análisis de sensibilidad: El análisis de sensibilidad en el contexto de la optimización de un sistema de trading algorítmico es un método utilizado para determinar cómo diferentes valores de los parámetros de entrada de un sistema afectan a su rendimiento. Este análisis es crucial para entender la robustez del sistema y para identificar qué parámetros son críticos y cómo su variación puede influir en los resultados del trading.

BMO (Average trade): Beneficio medio por operación.

INS: Muestra In Sample. Se refiere a la parte de la muestra de datos en la que se optimiza una estrategia.

OOS: Muestra Out of Sample. Parte de la muestra de datos a la que se le aplica la estrategia optimizada en la zona INS.

Stop Monetario: Stop loss en términos monetarios, por ejemplo, cerrar una posición cuando se alcanza una pérdida de 1000€.

Stop Porcentual: Stop loss en términos porcentuales. Se cierra una posición cuando se alcanza una pérdida de un porcentaje determinado en el trade.