

## GLOSARIO

### 5.7 DESARROLLO DE NUESTRO SISTEMA – OPTIMIZACIÓN VIII

**Anchored:** El término Anchored se refiere a una variación del método de optimización walk-forward. En esta versión el inicio de cada periodo INS está anclado (anchored) a la misma fecha de inicio. Es decir, todas las ventanas temporales IS comienzan en el mismo momento. Este proceso implica que cada optimización INS se hace sobre una cantidad de datos mayor a la anterior y que los datos “antiguos” se reutilizan, buscando cada vez los parámetros que mejor se adapten a grandes cantidades de situaciones de mercado. Esta es la versión que más similitud tiene con la optimización tradicional.

**Non-anchored:** Un método de optimización walk forward non-anchored se caracteriza por un desplazamiento fijo del inicio en cada ventana de tiempo. Esto significa que los distintos períodos de optimización IS tienen la misma duración, y se busca con ello que el sistema se adapte a los datos más recientes.

**BRAC:** Método de optimización de Keith Fitschen. Su nombre viene de las iniciales de “Build” (Construir), “Rebuild” (Reconstruir) y “Compare” (Comparar).