

GLOSARIO

5.6 DESARROLLO DE NUESTRO SISTEMA - EVALUACIÓN PRELIMINAR I

Forward testing: El forward testing es una forma de evaluar el rendimiento de un sistema de trading, aplicando sus reglas a datos no vistos por el optimizador.

Key reversal: Un key reversal es un patrón de trading que puede señalar la reversión de una tendencia. También se le conoce como “reversal day” o “one-day reversal”. El patrón se produce después de una tendencia alcista o bajista y se compone de tres elementos clave: Después de una tendencia alcista, la apertura debe estar por encima del cierre anterior, el día debe alcanzar un nuevo máximo y el cierre debe estar por debajo del mínimo anterior; después de una tendencia bajista, la apertura debe estar por debajo del cierre anterior, el día debe alcanzar un nuevo mínimo y el cierre debe estar por encima del máximo anterior.

Optimización exhaustiva: La optimización exhaustiva es un método de búsqueda que consiste en evaluar sistemáticamente todas las soluciones posibles para un problema, con el fin de encontrar la mejor solución. También se le conoce como “búsqueda exhaustiva” o “fuerza bruta”.

Walkforward testing: Walk forward testing es un método utilizado en finanzas para determinar los parámetros óptimos de una estrategia de trading y para evaluar la robustez de la estrategia. También se le conoce como “walk forward optimization”. El análisis de walk forward fue creado por Robert E. Pardo en 1992 y se considera ampliamente el “estándar de oro” en la validación de estrategias de trading. El proceso implica dividir los datos en varios conjuntos de entrenamiento y validación, y luego recorrer estos conjuntos optimizando los mejores valores en los conjuntos de entrenamiento y aplicándolos a los conjuntos de validación. El objetivo es encontrar los parámetros óptimos para una estrategia de trading y evaluar su robustez.