

GLOSARIO

6.2. EXPOSICIÓN O GESTIÓN MONETARIA

Fixed Fractional: Algoritmo de gestión monetaria en el que cada trade opera la misma fracción de capital por unidad de riesgo.

Fixed Ratio: El algoritmo de gestión monetaria "Fixed Ratio" es una estrategia de gestión de riesgo y tamaño de posición en el trading, desarrollada por Ryan Jones. La estrategia tiene como objetivo equilibrar el crecimiento y el riesgo al aumentar el tamaño de la posición a medida que crece la cuenta, pero de una manera más controlada en comparación con otras estrategias de gestión monetaria. La característica clave del método "Fixed Ratio" es su uso de un "delta" fijo para determinar cuándo aumentar el tamaño de la posición.

Fixed Size (Lote fijo): Algoritmo de gestión monetaria en el que siempre abre la misma cantidad de contratos.

F-Óptima: La F-óptima es una estrategia de gestión monetaria en el trading que busca maximizar la tasa de crecimiento geométrico de una cuenta de trading. Fue desarrollada por Ralph Vince, y es una parte fundamental de su teoría de gestión monetaria. Se determina a través de un análisis histórico de las operaciones de trading, encontrando la fracción óptima de capital que se debe arriesgar en cada operación para maximizar el crecimiento de la cuenta.

Fórmula de Kelly: Es un método matemático para determinar el tamaño óptimo de una serie de apuestas o inversiones, con el fin de maximizar el crecimiento del capital a largo plazo. La fórmula se basa en la relación entre las probabilidades de ganar y perder y la magnitud de las ganancias y pérdidas. En términos simples, la fórmula de Kelly calcula la proporción del capital total que se debe apostar en cada operación.

Probabilidad de Ruina: Concepto probabilístico utilizado en la gestión monetaria, que estima el riesgo de romper la cuenta operando una porción del capital determinado.