

## GLOSARIO

### 5.7 DESARROLLO DE NUESTRO SISTEMA – OPTIMIZACIÓN III

**Sharpe:** Métrica ampliamente utilizada, consiste en la rentabilidad media obtenida por encima de la tasa libre de riesgo dividida unidad de volatilidad de los retornos.

**Sortino:** Métrica que se obtiene al dividir la rentabilidad media obtenida por encima de la tasa libre de riesgo, por la desviación típica de los retornos negativos.

**TSI (TradeStation Index):** Métrica propia de la plataforma TradeStation que consiste en multiplicar el beneficio neto por el número de trades y a este resultado lo dividimos por el máximo drawdown intradía en valor absoluto.

**RRR (Return Retracement Ratio):** Métrica obtenida al dividir la rentabilidad media anualizada dividida por retroceso máximo medio.

**UPI (Ulcer Performance Index):** Métrica que mide la rentabilidad media obtenida por encima de la tasa libre de riesgo dividida por el Ulcer Index de la estrategia.

**Martingala:** En el contexto del trading, una martingala es una estrategia que implica ajustar el tamaño de las posiciones de manera que se aumenta la apuesta después de una pérdida, con el objetivo de recuperar las pérdidas anteriores y obtener una pequeña ganancia. Esta estrategia se originó en el juego de azar y se basa en la premisa de que, si algo sucede con cierta probabilidad, eventualmente ocurrirá y, por lo tanto, las pérdidas pueden recuperarse incrementando el tamaño de las operaciones sucesivas.