

Diagrama "Hoja de Seguimiento Diario de Sistemas"

A. Módulo Descripción del Sistema:
Se detallan las características del sistema, sus condiciones de trabajo y la del activo sobre el que se aplica

B. Módulo Test Profile:
Resumen estadístico que caracteriza el sistema, obtenido de la serie P&L Out of sample realizada por método RWFO. Obtenido del módulo G.

C. Módulo de Control Operativa Teórica :
Resumen estadístico
Drawdown
Slippage

D. Módulo de Estadístico de Proceso (SPC) :
Cuadro Izq: Resumen gráfico
Cuadro Dcho: Registro automático de datos

J. Módulo de Status:
Establece el Status del Sistema (verde OK o amarillo Alarma) en función del estado de los estadísticos:
T-test
SPC Medias
SPC Recorridos
Bandas de Montecarlo

I. Módulo de Gestión Monetaria:
En función de las características del sistema, Capital y riesgo asumido, establece el número de contratos adecuado para la próxima operación

E. Módulo de Incidencias :
Se describen aquellas incidencias que supongan observaciones, alarmas o fallos en la operativa o que hayan impedido la obtención de resultados equivalentes a los teóricos. Se anota el Informe al que refieren

H. Módulo de Registro:
Registro de operaciones reales y teóricas. Se calcula automáticamente P&L, Acumulados, Drawdowns, Slippage, T-test. Dispone de una columna para realizar el Autocontrol al final de cada trade y especificar el informe de alarma en caso de Incidencia

G. Módulo de Walk Forward:
Espacio destinado a ubicar el conjunto de los resultados P&L que constituye el Walk Forward y que es usado en el módulo B para obtener el Test Profile

F. Código de Programación :
La estrategia queda descrita en el lenguaje de programación correspondiente

