El resultado de todo el trabajo que se ha hecho hasta ahora se podría resumir en la obtención de una serie de resultados que si los ponemos uno detrás de otro nos configuran una curva de capital que pretende ser representativa del juego que hemos creado, en condiciones simuladas de la forma más realista que se puede obtener mediante backtest.

La Gestión Monetaria pretende responder a la pregunta sobre cuál es la manera óptima (de acuerdo a unos criterios dados), si existe, de “apostar” en cada jugada.

El objetivo final de este módulo consiste en proporcionar unos fundamentos matemáticos de la gestión del capital orientada a la maximización del retorno y cómo trasladar posteriormente dichos conocimientos a la esfera del trading de sistemas. Conocer la fórmula de un algoritmo de Money management no es suficiente para aplicarla a una cartera de sistemas, es necesario proceder de una forma estandarizada que permita a su vez un walk forward de los parámetros del algoritmo, por otro lado hay que tener muy en cuenta las garantías necesarias en el trading, algo que los estudios académicos suelen obviar.

Por último hay que tener en cuenta que cualquier aproximación que empleemos como Money management va a variar tanto el retorno como el máximo drawdown del conjunto, en ambos casos al alza, es por esta razón por lo que todo el énfasis en el diseño de los sistemas y de las carteras se enfocan a reducir al máximo dicho drawdown…teniendose siempre en cuenta que ya se encargará el algoritmo de turno de multiplicarlo.

Como en los anteriores módulos, la estructura del manual se divide en 3 bloques de teoría, práctica y al final el Procedimiento escrito. El alumno tendrá que realizar dicho procedimiento sobre la cartera aportada. El resultado de todo este proceso se condensa en el “Final Profile” que es la caracterización de nuestro portfolio con la gestión monetaria implementada

Los tutores responderán en los foros específicos a todos las dudas y dificultades que puedan plantearse. También iremos incorporando material complementario a medida que avance la actividad, cuya duración prevista es de un mes.