



## PROGRAMA INTENSIVO EN PROBABILIDADES Y MONEY MANAGEMENT

<b>Correo:</b>	<a href="mailto:soporte@matematicadeltrading.com">soporte@matematicadeltrading.com</a>
<b>WEB:</b>	<a href="https://xn--matemticadeltrading-uub.com/servicios">https://xn--matemticadeltrading-uub.com/servicios</a>
<b>Objetivos:</b>	<p><b>OBJETIVOS ESPECÍFICOS:</b></p> <p>Convertir a los suscriptores en inversores capacitados para el diseño y gestión de portafolios de sistemas de trading. Para lo cual consideramos profundizar los siguientes conocimientos y habilidades personales:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- Actualizar los conocimientos sobre el funcionamiento general de los mercados financieros.</li><li>- Conocer los fundamentos del análisis técnico aplicado al trading y del ciclo de producción de sistemas.</li><li>- Adquirir las competencias necesarias para diseñar y evaluar estrategias basadas en reglas discretas con diferentes lógicas, horizontes temporales y mercados.</li><li>- Construir portafolios de sistemas que respondan a distintos criterios de inversión y perfiles de aversión al riesgo.</li><li>- Conocer el marco teórico y la aplicación práctica de los algoritmos de gestión monetaria.</li><li>- Capacidad para gestionar la operativa y tomar decisiones basadas en un procedimiento objetivo de gestión del trading.</li></ul>
<b>Temario:</b>	<ol style="list-style-type: none"><li>1. NOCIONES BÁSICAS DE MERCADOS FINANCIEROS. 1.1 Valor temporal del dinero. 1.2 Productos financieros 1.2.1 Acciones. 1.2.2 Bonos. 1.2.3 Derivados. Futuros y Opciones 1.2.4 FOREX 1.3 Libro de Órdenes. Tipos de Órdenes.</li><li>2. INTRODUCCIÓN A TRADING DE SISTEMAS. 2.1 Iniciación al mundo de los sistemas de trading. 2.2 El ciclo de producción de sistemas. 2.3 Análisis técnico orientado a los sistemas de trading.</li><li>3. DISEÑO DE SISTEMAS. 3.1 Marco teórico. 3.2 Procedimiento de diseño. Visión general. 3.3 Elementos del proceso de diseño. 3.4 Paso a paso en el desarrollo de una estrategia (reglas de posicionamiento, mecanismos de salida, aplicación de filtros, etc.) 3.5 Estudios de caso: Análisis práctico de estrategias que responden a diferentes estilos de inversión.</li><li>4. EVALUACIÓN DE SISTEMAS. 4.1 Visión global del testeo de una estrategia. 4.2 Criterios básicos de evaluación. 4.3 Procesos de optimización. 4.4 Método Walk Forward. 4.5 Simulaciones de Montecarlo. 4.6 Test-Profile. 4.7 Procedimiento de evaluación de sistemas. 4.8 Desarrollo práctico y estudios de caso.</li><li>5. OPERATIVA. 5.1 Introducción a la operativa. 5.2 Modelos de carteras estáticas y dinámicas. 5.3 Sistemas de trading para portafolios.</li><li>6. CREACIÓN DE CARTERAS. 6.1 Qué es un portafolio de sistemas. 6.2 Rentabilidad y riesgo de una cartera. 6.3 Diversificación. 6.4 Modelos de asignación y ponderación de activos. 6.5 Benchmarks para portafolios de sistemas. 6.6 Procedimiento de creación de carteras. 6.7 Estudios de caso sobre: Valoración de una cartera, asignación de activos en la práctica y técnicas de rebalanceo.</li><li>7. GESTIÓN MONETARIA. 7.1 Fundamentos teóricos y conceptos matemáticos relacionados con el Money Management (MM). El apalancamiento asimétrico. La esperanza matemática / Pay off ▪ Probabilidad de ruina - risk of ruin- . 7.2 Principales estrategias de MM: Fixed Fractional o Fixed Risk , Profit Risk Method, Criterio de Kelly, F-Optima, Secure-F, Fixed Ratio. 7.3 Nociones de MM avanzado. 7.4 Procedimiento de MM: Selección del modelo, optimización, walk-forward, análisis de Montecarlo, test-profile. 7.5 Paso a paso en la implementación de un algoritmo de MM. 7.6 Estudios de caso sobre implementación de MM en sistemas y portafolios.</li><li>8. GESTIÓN DE LA OPERATIVA. 8.1 Marco teórico. 8.2 Gestión y monitorización de la operativa 8.3 Procedimiento de gestión del trading.</li></ol>

ÚNETE A NUESTRA COMUNIDAD



## Programa Intensivo En Probabilidades & Money Management

Conviértete en un inversor capacitado para el diseño y gestión de portafolios de sistemas de trading. Conoce y profundiza el ciclo de producción de sistemas de inversión. Adquiere las competencias necesarias para diseñar y evaluar estrategias basadas en reglas discretas con diferentes lógicas, horizontes temporales y mercados. Construye portafolios de sistemas que respondan a distintos criterios de inversión y perfiles de aversión al riesgo. Conoce el marco teórico y la aplicación práctica de los algoritmos de gestión monetaria y probabilidades. Elimina los sesgos cognitivos de tu operativa, trabaja con modelos probabilísticos y obtén una ventaja estadística.

Descargar Brochure



Muy satisfecha, su metodología de enseñanza me permitió entender como una inversión exitosa consiste en saber gestionar el riesgo y no en evitarlo, pues la incertidumbre es parte de las probabilidades en el trading.



Ana Cornejo F.



Pude reestructurar creencias erradas, generar una ventaja al mercado mediante la aplicación de las matemáticas en mis operaciones. El análisis técnico es lo de menos todo se basa en la gestión monetaria.



Rafael Navarro D.



Si tan solo hubiera conocido estos temas no hubiese perdido mucho dinero por tanto tiempo, para alcanzar la rentabilidad es obligatorio basarnos en el análisis de las probabilidades permitiendo reducir la influencia emocional.



Arnau Prieto V.

# 50%

## DE DESCUENTO!

### Programa Intensivo en Probabilidades y Money Management

🔥 PROMOCIÓN ESPECIAL DE LANZAMIENTO 🔥

🛒 50% de descuento

👉 <https://xn--matematicadeltrading-uub.com/servicios/>