

CURSO DE DESARROLLO DE SISTEMAS DE TRADING

Consultar convocatorias en nuestras páginas web o en el 91.8015243

www.rsidat.com
www.hispafinanzas.com

Objetivo del Curso

En este curso tendrá la oportunidad de adquirir los conocimientos básicos e imprescindibles para el diseño, programación, evaluación y puesta en marcha de sus sistemas de trading. Este curso es sólo el punto de partida para adentrarse en el fascinante mundo de los sistemas de trading.

No tenemos interés especial en que opere con una determinada agencia de valores, tampoco tenemos interés en ofrecerles nuestros sistemas de trading, nuestro único interés es que Ud. aprenda realmente a trabajar con sistemas, **solo así podrá evaluar cualquier sistema que caiga en sus manos y desarrollar sus propias estrategias.**

Si piensa que en este curso le vamos a dar cuatro fórmulas mágicas para hacerse rico, le recomendamos que no pierda ni su tiempo ni su dinero. Se trabajará con las herramientas más utilizadas del mercado por los mejores especialistas del mercado. Asimismo, se realizará una introducción a los conceptos básicos del **money management** y los **condicionantes psicológicos** que mueven los mercados.

Los conocimientos transmitidos en el curso son el resultado de muchos años de investigación en el desarrollo de sistemas de trading y el coste del mismo se habrá amortizado con creces cuando diseñe su propio sistema o cuando sea capaz de seleccionar el mejor de los sistemas que le puedan ofrecer en función de sus características personales: Capital Inicial, aversión al riesgo, disponibilidad de tiempo, etc.

Metodología del Curso.

Se trata de un curso totalmente práctico, donde cada alumno cuenta con su ordenador y todos los ejemplos se han elaborado con situaciones reales. Para apoyarnos en estas prácticas contaremos con los programas **TradeStation** y **MetaStock** y bases de datos históricas tanto diarias como intradiarias de Rsidat.com, y veremos como nos podemos auxiliar de software complementario como **Excel**, para elaborar información más detallada sobre el rendimiento de nuestros sistemas. De las 20 horas lectivas, 5 se destinan a prácticas con software especializado.

Profesores.

- ◆ D. Alexey De La Loma.
- ◆ D. Antonio Carcelén.

Duración, fechas y lugar de celebración.

La duración del curso se puede dividir en dos componentes:

- ⇒ **Presencia física** en nuestras oficinas, durante las 20 horas lectivas repartidas en 3 sesiones: viernes y sábado durante todo el día y domingo por la mañana.
- ⇒ **Soporte online** durante 60 días en nuestro Foro privado del Curso de Desarrollo de Sistemas.

Lugar de celebración: Oficinas de **CVC DATASOFT S.L.**, ubicadas en Ciempozuelos (Madrid). Si necesitan que les gestionemos la reserva en algún hotel de la zona, por favor háganoslo saber con la suficiente antelación.

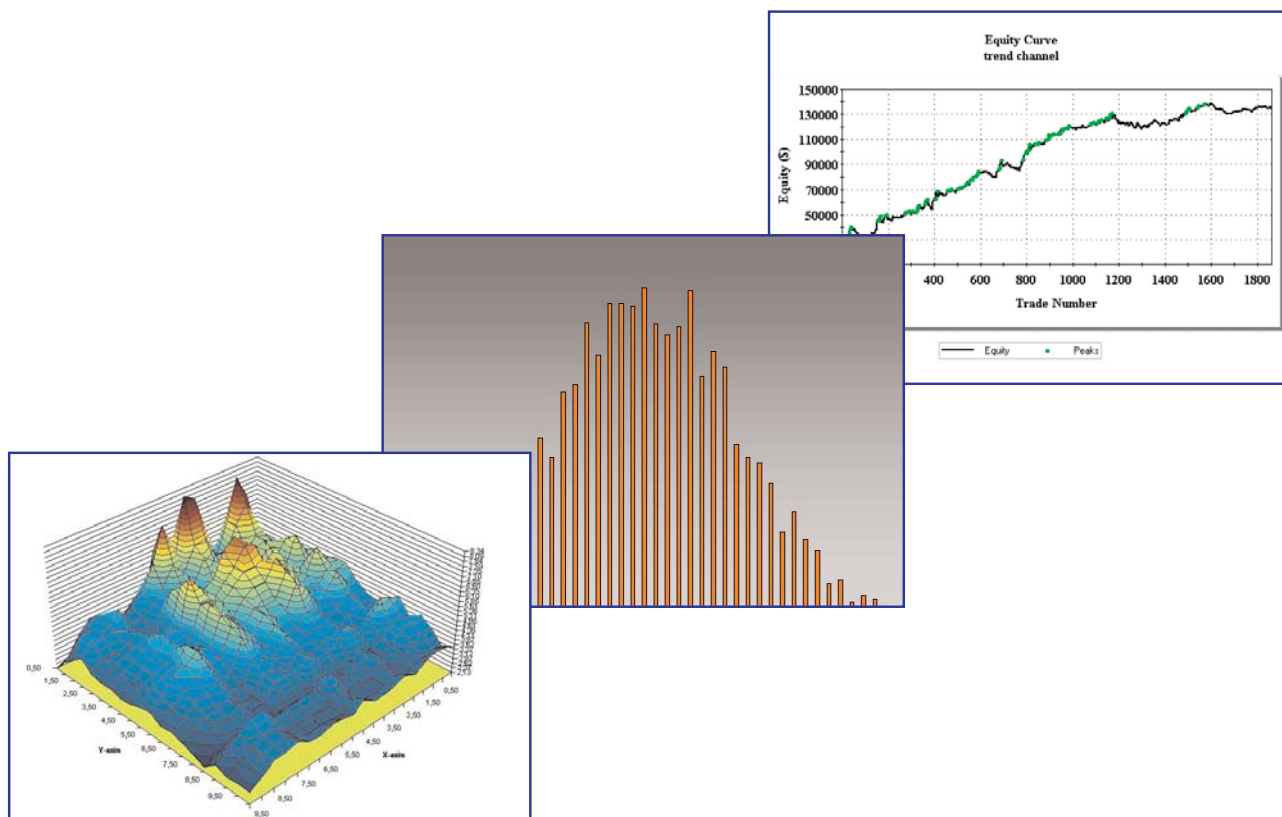
Inscripción y Condiciones Económicas.

Para hacer su reserva de plaza deberá rellenar y enviarnos nuestro formulario de reserva de plaza, una vez lo recibamos le confirmaremos dicha reserva y le informaremos de la forma en la que puede efectuar el pago de dicha reserva (200 Euros). Solo se admiten un **máximo 15 plazas** y el coste del curso es de 750 Euros (precio sin IVA), sobre el que se aplicarán los siguientes descuentos, no acumulables:

- ⇒ **5% de descuento** para los suscriptores Ed. Gratuita del Boletín Bursátil RSIDAT a fecha 01/12/06.
- ⇒ **10% de descuento** para los usuarios de rsidat.com a fecha 01/12/06 y para los suscriptores Ed. Premium del Boletín Bursátil RSIDAT a fecha 01/12/06.
- ⇒ **15% de descuento** si una empresa envía a dos personas o se apuntan dos personas de forma conjunta. Las empresas podrán reemplazar al participante inscrito por otro de la compañía sin cargo alguno.

El coste del Curso incluye:

- ◆ Comida de los tres días del curso: Viernes, Sábado y Domingo.
- ◆ Se le hará entrega de diversas bases de datos intradiarias chequeadas y libres de errores para que hagan las prácticas.
- ◆ Durante 6 meses, si lo desea recibirá, de forma totalmente gratuita, datos intradiarios del Meff fin de día o Eurex fin de día; así podrá ir poniendo en práctica todo lo aprendido.(*)
- ◆ Documentación completa sobre el contenido del curso, que incluye dos manuales de más de 150 páginas cada uno, elaborados por Alexey De La Loma.
- ◆ Acceso a nuestro foro privado durante 60 días, donde podrá seguir con la formación y compartir con el resto de asistentes los conocimientos adquiridos.
- ◆ Suscripción gratuita durante 6 meses a la Ed. Premium Boletín Bursátil RSIDAT.(*)
- ◆ Si lo desea descuento del 30% en el servicio de datos de Rsidat.com.(*)
- ◆ Descuentos del 15% en todos los packs de la librería on line www.hispafinanzas.com, especializada en trading y bolsa.



(*) Oferta válida para nuevos suscriptores.

Alexey De La Loma.

Licenciado en Economía y Diplomado en Ciencias Empresariales por la Universidad Carlos III de Madrid. Comenzó su carrera profesional en grandes empresas, como CLH, Arthur Andersen, Grupo Santander Central Hispano e IBM, con amplia experiencia profesional en otros países (Inglaterra, Italia, Portugal, Chile, Perú y Argentina). Es socio fundador de TradeSolver S.L., empresa que gestiona el portal de trading www.hispatrading.com y la librería financiera www.hispafinanzas.com.

Desde el año 2001 se dedica, exclusivamente, a los mercados financieros, como Trader por cuenta propia y especialista en Money Management, sistemas automáticos de inversión a corto plazo y Técnicas Cuantitativas aplicadas a los mercados financieros. Publica regularmente en el boletín de RSIDAT desde junio de 2003 y en la revista Gestión Alternativa desde Julio de 2004, contando con más de 25 artículos publicados.

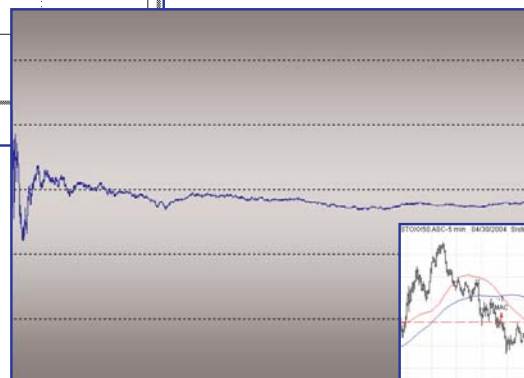
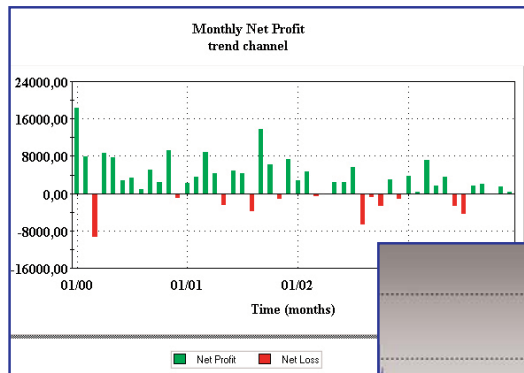
Autor del libro:

- ♦ "Las voces de los maestros de los mercados financieros". Millenium Capital, 2006.

Antonio Carcelén.

Diplomado en Empresariales por la Universidad de Granada. Director de www.rsidat.com, lleva en contacto con los mercados desde el año 1991. Desde 1994 dirige CVC DATASOFT S.L. Desarrolla formulas a petición de sus clientes y está suscrito a varios foros americanos de desarrollo de sistemas.

Es un absoluto convencido de la bondad de los sistemas automáticos de trading bien diseñados. Imparte regularmente cursos sobre el manejo del programa de Análisis Técnico MetaStock. Desde Octubre de 2002 es Editor del Boletín Bursátil RSIDAT www.boletinbursatilrsidat.com. En estos años ha escrito artículos en diferentes medios y ha impartido varias conferencias sobre bases de datos, su calidad, software específico, etc.



DESARROLLO DE SISTEMAS DE TRADING

LUGAR DE CELEBRACIÓN:	OFICINAS DE RSIDAT EN MADRID (CIEMPOZUELOS).
FECHA DE CELEBRACIÓN:	CONSULTAR CONVOCATORIAS ABIERTAS
GRUPOS REDUCIDOS:	15 PERSONAS MÁXIMO.
DURACIÓN:	20 HORAS LECTIVAS.
TFNO Y CORREO DE CONTACTO:	91.801.52.43 (DOS LÍNEAS) ; formacion@rsidat.com
HORARIO DEL CURSO:	V: 11:00-14:00 y 16:00-20:00, S: 10:00-14:00 y 16:00-20:00, D: 10:00-15:00.
PRECIO DEL CURSO:	750€(IVA NO INCLUIDO).
PONENTES:	ALEXEY DE LA LOMA y ANTONIO CARCELÉN.



I. INTRODUCCIÓN A LOS SISTEMAS DE TRADING

Definición de sistema de trading.
Qué es un sistema de trading.
Sistemas discrecionales, sistemas mecánicos y sistemas automáticos.
Puntos fuertes y puntos débiles.
Trading vs. inversión [Buy and Hold].
Acciones vs. futuros. tendencia vs. contra-tendencia.
Postura académica: Teoría del paseo aleatorio.
Mercado eficiente y sistemas de trading.
Sistemas de trading universales.
Ejemplo de operativa real automatizada.
Plan de trading.
Psicología, money management y sistema.
Management completo.
Evolución del trader de sistemas.
Trader discrecional.
Trader técnico.
Trader iniciado en sistemas.
Trader experto en sistemas.

II. HERRAMIENTAS Y REQUERIMIENTOS

Hardware y Software.
Requerimientos de Hardware.
Software Imprescindible: TradeStation, MetaStock, Visual Chart, Wealth-lab.....
Software Complementario: Rina, ProSizer, NeuroShell, Portfolio Evaluator, Excel.....
Formación: Bibliografía y Seminarios.
Bases de datos de cotizaciones.
Introducción.
Gráficos ajustados vs. Gráficos no ajustados.
Qué formato de bases de datos debemos utilizar.
Cómo ajustar nuestras bases de datos.
Cómo crear nuestras bases de datos.
Vendors Feed.
Referencias bibliográficas comentadas.

III. ANÁLISIS TÉCNICO, ESTADÍSTICA E INTELIGENCIA ARTIFICIAL

Introducción al Análisis Técnico.
Indicadores de tendencia (medias móviles, rotura de rangos, ADX).
Indicadores de contra-tendencia (RSI, Estocástico, MACD).
Indicadores de volatilidad (ATR, Bollinger bands).
Introducción a la Estadística.
Media, Moda, Mediana y Desviación típica.
Tipos de distribuciones. Normal y Lognormal.
Coeficiente de correlación.
Inteligencia Artificial.
Sistemas expertos y redes neuronales.
Algoritmos genéticos y Lógica difusa.

IV. COMPONENTES DE UN SISTEMA Y TIPOLOGÍA

Componentes de un sistema.
Reglas de Entrada y de Salida. Indicadores técnicos.
Parámetros. Filtros y Stops.

Gestión del Riesgo o Risk Management.
Tipos de stop loss.
Profit Targets.
Eficiencia en Entradas y Salidas. MAE vs. MFE.
Estrategias con Outliers. Rina Index.
Tipos de Sistemas de Trading.
Según el grado de discrecionalidad.
Según la serie histórica y el posicionamiento.
Clasificación fundamental.
Resto de Sistemas.
Trend Following y Market Facilitation.

V. FASES EN EL DESARROLLO DE SISTEMAS

Selección de Mercados y Activos Financieros.
Qué tipo de comportamiento de mercado estoy buscando.
Volatilidad y liquidez.
Qué producto se ajusta mejor a mis necesidades.
Definición de la operativa que estamos buscando.
Time Frame (Intraday, daily, weekly).
Desarrollo de la idea genérica.
Transformación de la idea en un conjunto de reglas objetivas.
Backtesting y optimización de parámetros.
Mantenimiento y mejora del sistema desarrollado.

VI. EVALUACIÓN DE LOS RESULTADOS

Objeto de la evaluación. objetividad vs. subjetividad.
Análisis numérico o de ratios.
Número de operaciones.
Resultado bruto. Comisiones y slippage.
Fiabilidad vs. AverageWin/AverageLoss. Payoff ratio.
Profit factor.
Return on Account. Ratios de rentabilidad riesgo.
Sharpe Ratio.
K-Ratio.
Análisis gráfico.
Equity curve analysis.
Análisis temporal.
Resultados netos semanales, mensuales y anuales.
Tiempo en mercado y duración de las operaciones.
Análisis del drawdown.
Definición.
DrawDown inicial vs. completo.
DrawDown diario vs. intradiario.
DrawDown de posiciones abiertas vs. de posiciones cerradas.
UnderWater Equity Curve.
Simulaciones de Montecarlo.
Números aleatorios y Semilla (SEED).
Objeto de la Simulación. Aplicación al Trading.
Montecarlo en la práctica.

VII. OPTIMIZACIÓN: ROBUSTEZ VS. CURVE FITTING

Optimización: amigo o enemigo.
Tipos de Optimizadores.
Evolución del trader ante la optimización.
Ejemplos de curve-fitting.
Formas de evitar el curve-fitting.

Mapas de Optimización. Robustez.
Gráficos en dos dimensiones.
Gráficos en tres dimensiones.
Alternativas a la Optimización tradicional.
Optimización Proyectada(W.F.O.).
Sistemas auto-adaptados (Self-Adaptive Sys.).

VIII. CONDICIONANTES PSICOLÓGICOS. SISTEMAS AUTOMÁTICOS

Porque es tan importante la psicología.
Miedo y avaricia.
Control emocional.
Exceso de confianza.
El santo grial está en nuestro interior.
Cuidado con la Intuición.
Contabilidad mental.
Psicología de masas.
Desde la tulipmania a la burbuja de internet.
Disciplina y seguimiento del sistema en tiempo real.
La importancia de la disciplina.
Diario de las operaciones reales vs. teóricas.
Técnicas para mejorar nuestra operativa.
Sistemas automáticos vs. sistemas mecánicos.
Elimine sus limitaciones emocionales.

IX. MONEY MANAGEMENT

Desarrollo post-sistema.
Money management, ese gran desconocido.
Qué es money management.
Qué no es money management.
El experimento de Ralph Vince.
Gestión Monetaria y Draw. El uncle point.
Martingala vs. Antimartingala.
Apalancamiento asimétrico.
Las tres fases en la implementación de la gestión monetaria.
Estrategias de gestión monetaria.
Fixed fraction.
Optimal f.
Secure f.
Regla del 2%.
Fixed ratio.

X. PORTFOLIO MANAGEMENT

Portfolio management o diversificación.
El milagro de la diversificación.
Tipología de la Diversificación.
Efecto en los ratios y en la Equity Line.
Ejemplos prácticos de aplicación de diversificación.
Sistema TradeSolver I sobre portfolio de acciones del EuroStoxx50.
Sistema TradeSolver II sobre portfolio de acciones del EuroStoxx50.
Portfolio de Sistemas sobre el Futibex-35.