



visualchart

# Herramientas de análisis. Estadísticas de sistemas

VISUAL CHART GROUP · DEPARTAMENTO DE  
FORMACIÓN





visualchart

## Contenido

- ✓ Introducción
- ✓ Visualizar estadísticas de una estrategia de trading (insertada sobre gráfico)
- ✓ Gestión de plantillas y grupos estadísticos
- ✓ Actuaciones sobre las estadísticas de sistemas
- ✓ Preguntas y respuestas



## Introducción

Las estadísticas de sistemas arrojan unos resultados que permiten sopesar la bondad de cualquier método de inversión ideado, repercutiendo de forma positiva en las aplicaciones futuras del sistema de inversión.

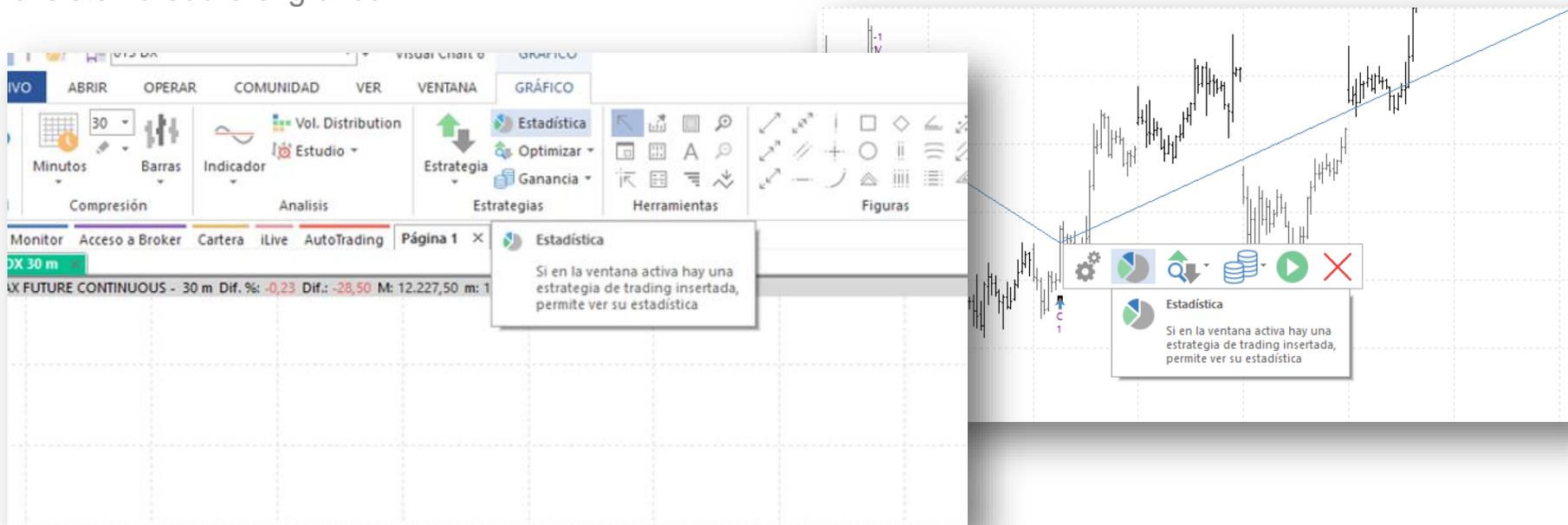
En Visual Chart 6 el usuario de estrategias de trading dispone de más de 150 datos estadísticos que permiten evaluar las características de un sistema de trading.



## Visualizar estadística de una estrategia de trading (insertado sobre el gráfico)

Para mostrar los resultados estadísticos de un sistema insertado sobre el gráfico, es preciso pulsar sobre el comando **Estadística** del menú **Gráfico**.

También se accede al comando **Estadística** haciendo clic sobre una de las señales de compra/venta que dibuja el sistema sobre el gráfico.



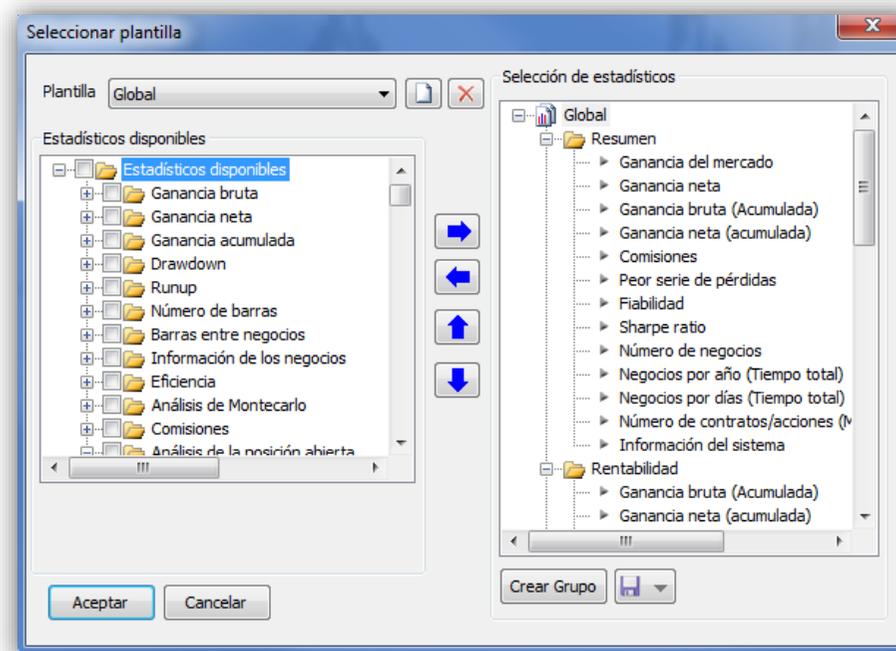


## Visualizar estadística de una estrategia de trading (insertado sobre el gráfico)

Se mostrará el cuadro de diálogo **Seleccionar plantilla**, los datos estadísticos que mostraremos.

Para una rápida localización de los mismos, se encuentran clasificados por categorías según el tipo de información que proporcionan.

Visual Chart 6 incorpora una plantilla por defecto (Global) que incorpora un conjunto de variables estadísticas de distintas categorías.



## Visualizar estadística de una estrategia de trading (insertado sobre el gráfico)

Tras pulsar el botón **Aceptar** se muestra la estadística del sistema:



La ventana se encuentra dividida en 2 partes:

- Grupos y estadísticos (Izquierda). En ella se encuentran los diferentes conceptos y sus resultados.
- Análisis por negocios en representación gráfica y en tabla (Derecha). Muestra información detallada de cada uno de los estadísticos seleccionados en la ventana Grupos y Estadísticos.



visualchart

## Visualizar estadística de una estrategia de trading (insertado sobre el gráfico)

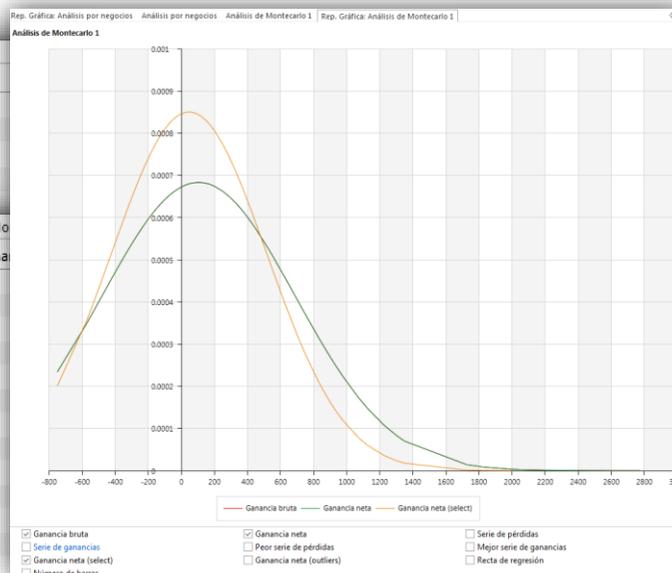
La gráfica representa los valores estadísticos a lo largo del tiempo analizado.

En la tabla se observan los valores en cada operación realizada por el sistema.

En función de los estadísticos seleccionados en la ventana **Grupos y estadísticos**, pueden mostrarse más solapas para representar de forma detallada dicha información.

Rep. Gráfica: Análisis por negocios	Análisis por negocios	Análisis de Montecarlo 1	Rep. Gráfica: Análisis de Montecarlo 1
Estadísticos disponibles		Sistema	Montecarlo
1	Ganancia bruta	825,000	(-1.039,863; 1.248,263) 104,200
2	Ganancia neta	825,000	(-1.039,863; 1.248,263) 104,200
3	Serie de pérdidas	-300,000	(-6.782,315; 1.997,915) -2.392,200
4	Serie de ganancias	40.250,000	(37.204,304; 44.983,696) 41.094,000
5	Peor serie de pérdidas	-6.900,000	(-12.101,795; -4.049,405) -8.075,600

Rep. Gráfica: Análisis por negocios	Análisis por negocios	Análisis de Montecarlo 1	Rep. Gráfica: Análisis de Montecarlo 1		
Compra / Venta	Fecha de entrada	Fecha de salida	Punto de entrada	Punto de salida	Gana
1	27/04/2015 11:25	27/04/2015 17:15	20.055,000	20.115,000	
2	27/04/2015 17:15	27/04/2015 19:25	20.115,000	20.110,000	
3	28/04/2015 06:30	28/04/2015 11:10	20.080,000	20.040,000	
4	28/04/2015 19:20	29/04/2015 07:25	20.010,000	19.950,000	
5	29/04/2015 14:10	30/04/2015 00:40	19.920,000	19.850,000	
6	30/04/2015 01:05	30/04/2015 13:40	19.795,000	19.540,000	
7	30/04/2015 17:50	30/04/2015 23:05	19.480,000	19.450,000	
8	30/04/2015 23:05	01/05/2015 04:45	19.450,000	19.495,000	
9	01/05/2015 06:50	04/05/2015 00:50	19.530,000	19.715,000	
10	04/05/2015 00:50	04/05/2015 09:35	19.715,000	19.705,000	
11	04/05/2015 09:35	04/05/2015 17:40	19.705,000	19.745,000	
12	05/05/2015 03:30	05/05/2015 09:20	19.750,000	19.735,000	
13	05/05/2015 13:40	05/05/2015 23:25	19.725,000	19.415,000	
14	05/05/2015 23:25	06/05/2015 06:15	19.415,000	19.430,000	1.140,000
15	06/05/2015 13:20	06/05/2015 21:00	19.400,000	19.335,000	1.205,000
16	07/05/2015 16:30	08/05/2015 01:05	19.345,000	19.355,000	1.215,000



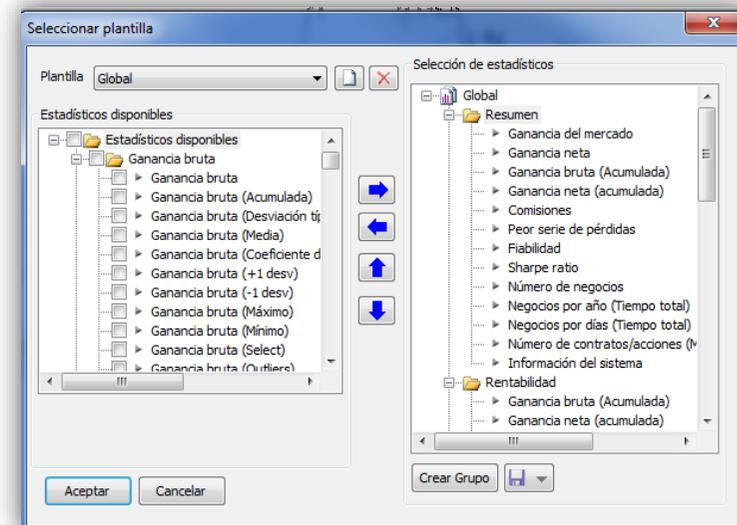
## Gestión de plantillas y grupos estadísticos

**Visual Chart 6** permite que el usuario pueda configurar la lista de variables estadísticas que desea consultar, teniendo opción de:

- Modificar una plantilla existente
- Crear una plantilla nueva
- Crear y eliminar grupos estadísticos dentro de una plantilla
- Eliminar plantilla

Pulsando sobre las flechas situadas en la parte central del cuadro, es posible modificar la plantilla escogida (Global), añadiendo o eliminando elementos de la ventana Estadísticos disponibles.

Para cambiar el orden los conceptos sólo es necesario arrastrarlos hacia arriba/abajo, manteniendo el botón izquierdo del ratón pulsado o utilizando las flechas.



## Gestión de plantillas y grupos estadísticos

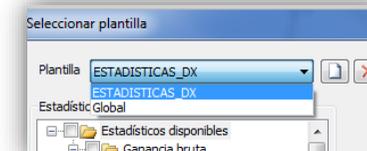
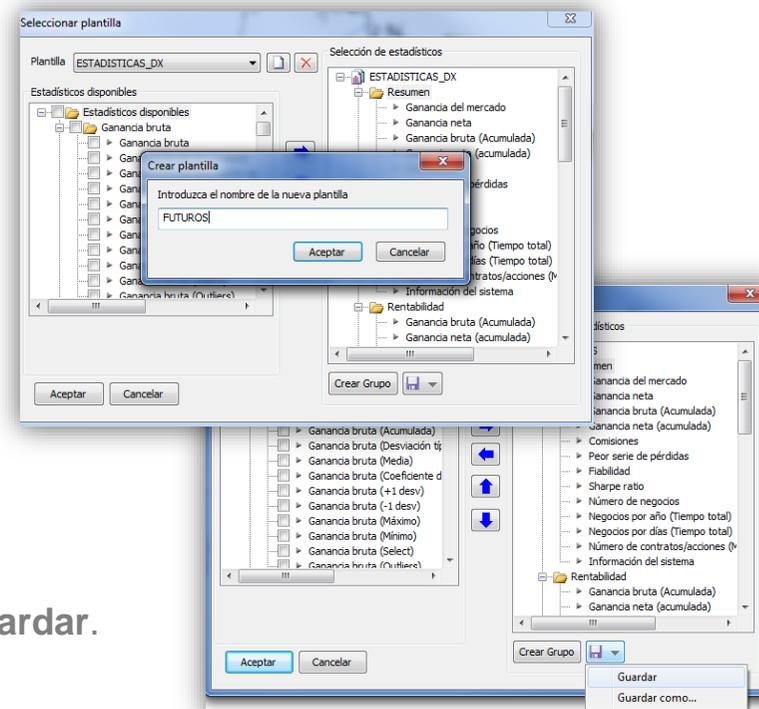
Para la creación de una plantilla, pulsaremos sobre el comando Estadística del menú **Gráfico**, de esta forma se visualizará la ventana **Seleccionar plantilla**.

Una vez que damos un nombre a la plantilla nueva, tan sólo será preciso añadir/eliminar o variar el orden de los conceptos estadísticos en la ventana **Selección de estadísticos** tal y como hacemos para modificar una plantilla existente.

Incluso podemos crear nuevos grupos como veremos a continuación.

Para guardar la plantilla creada es preciso pulsar la opción **Guardar**.

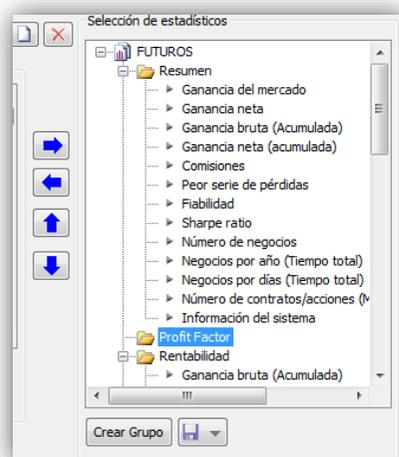
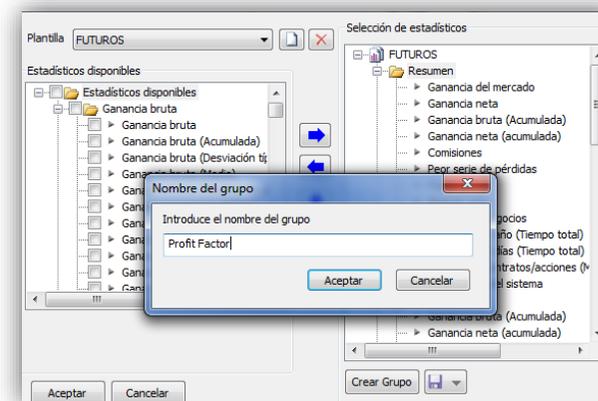
Es posible eliminar una plantilla estadística de forma rápida, seleccionando ésta en el desplegable **Plantilla** y pulsando sobre el botón



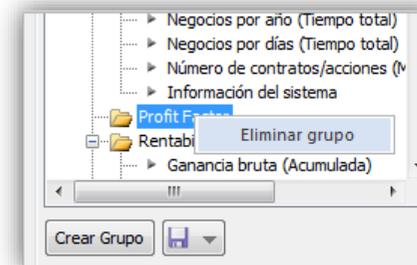
## Gestión de plantillas y grupos estadísticos

Para crear un grupo nuevo, pulsaremos el botón **Crear Grupo**, y como aparece en la imagen, se abrirá una ventana para introducir el nombre del mismo. Tras pulsar Aceptar se añadirá el grupo en la ventana Selección de estadísticos.

Arrastrando un grupo hacia arriba/abajo, manteniendo el botón izquierdo del ratón pulsado, cambiaremos el orden en el que aparece dentro de la plantilla.



Para eliminar un grupo basta con seleccionar la carpeta correspondiente y pulsar la tecla Supr.



## Actuaciones sobre las estadísticas de un sistema

A través del menú **Estadística**, podremos filtrar la información etc. Solo se visualiza este menú cuando tenemos activa la ventana de estadística de algún sistema.

Visual Chart 6 ofrece a los usuarios la posibilidad de filtrar la información en función de diferentes criterios:

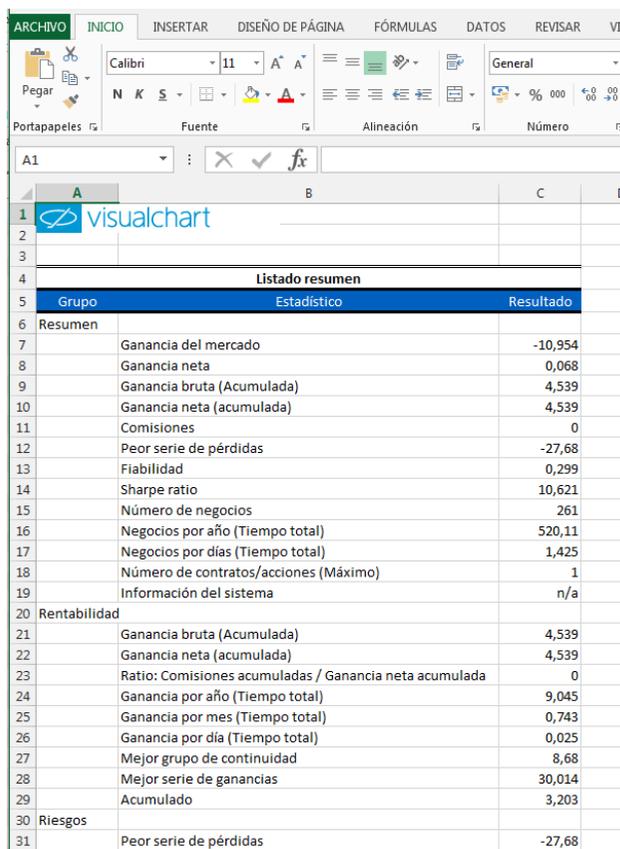
- Intervalo de tiempo analizado
- Resultados positivos/negativos
- Unidad en la que se expresa el resultado (% , por puntos y moneda).
- Posición (corto/largo)
- Compresión (negocios, días, meses..)

Los filtros aplicados se pueden predeterminar y restaurar.

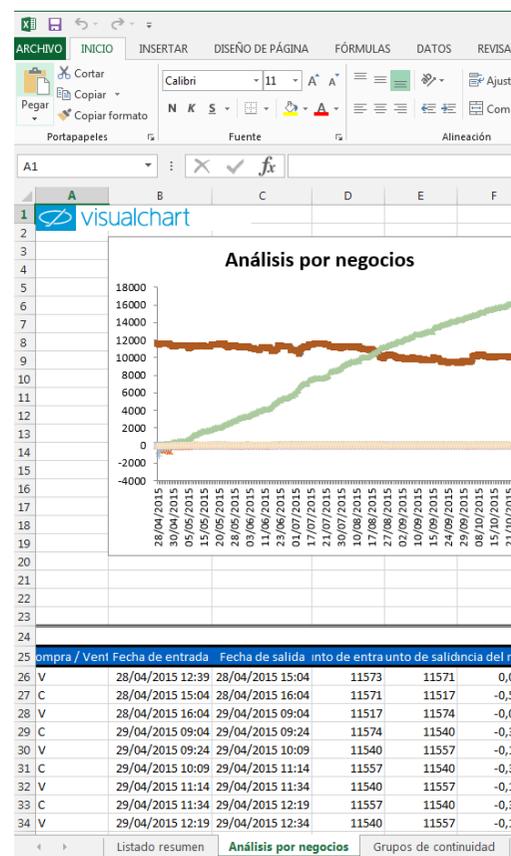


## Actuaciones sobre las estadísticas de un sistema

Utilizando el menú **Exportar**, disponemos en un instante de los resultados de la misma en un libro de Excel.



Listado resumen		
Grupo	Estadístico	Resultado
Resumen		
	Ganancia del mercado	-10,954
	Ganancia neta	0,068
	Ganancia bruta (Acumulada)	4,539
	Ganancia neta (acumulada)	4,539
	Comisiones	0
	Peor serie de pérdidas	-27,68
	Fiabilidad	0,299
	Sharpe ratio	10,621
	Número de negocios	261
	Negocios por año (Tiempo total)	520,11
	Negocios por días (Tiempo total)	1,425
	Número de contratos/acciones (Máximo)	1
	Información del sistema	n/a
Rentabilidad		
	Ganancia bruta (Acumulada)	4,539
	Ganancia neta (acumulada)	4,539
	Ratio: Comisiones acumuladas / Ganancia neta acumulada	0
	Ganancia por año (Tiempo total)	9,045
	Ganancia por mes (Tiempo total)	0,743
	Ganancia por día (Tiempo total)	0,025
	Mejor grupo de continuidad	8,68
	Mejor serie de ganancias	30,014
	Acumulado	3,203
Riesgos		
	Peor serie de pérdidas	-27,68

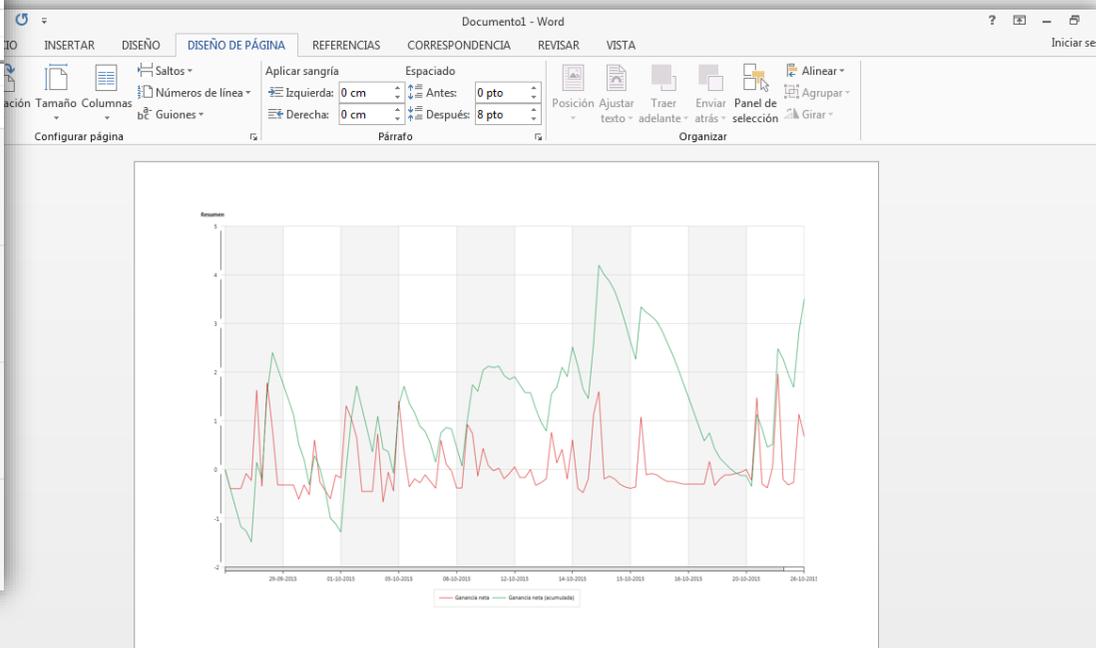
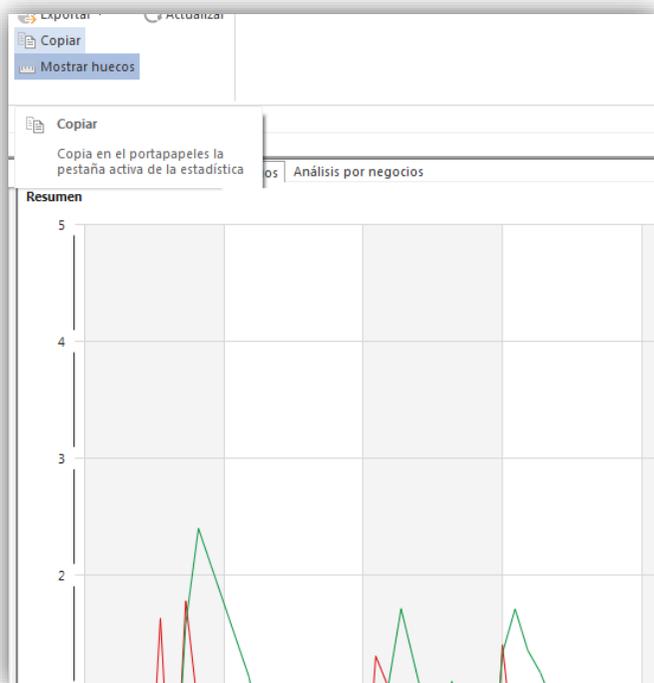




visualchart

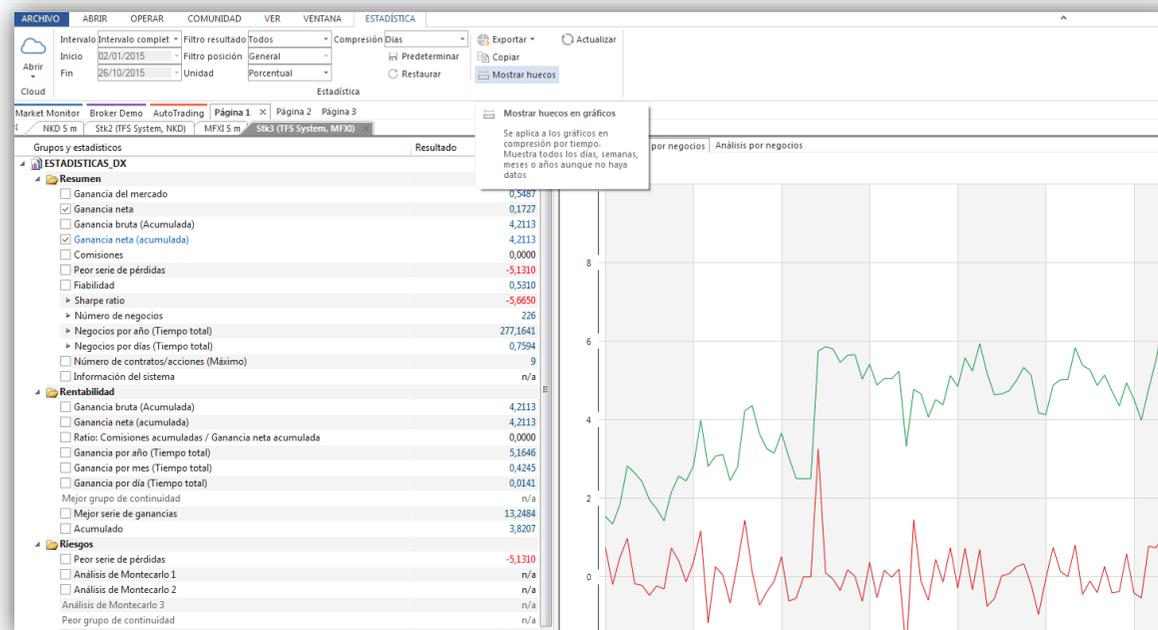
## Actuaciones sobre las estadísticas de un sistema

Podemos **copiar los datos estadísticos**, de una ventana previamente seleccionada, en cualquier documento (p.e word) utilizando el comando copiar del menú **Estadística**.



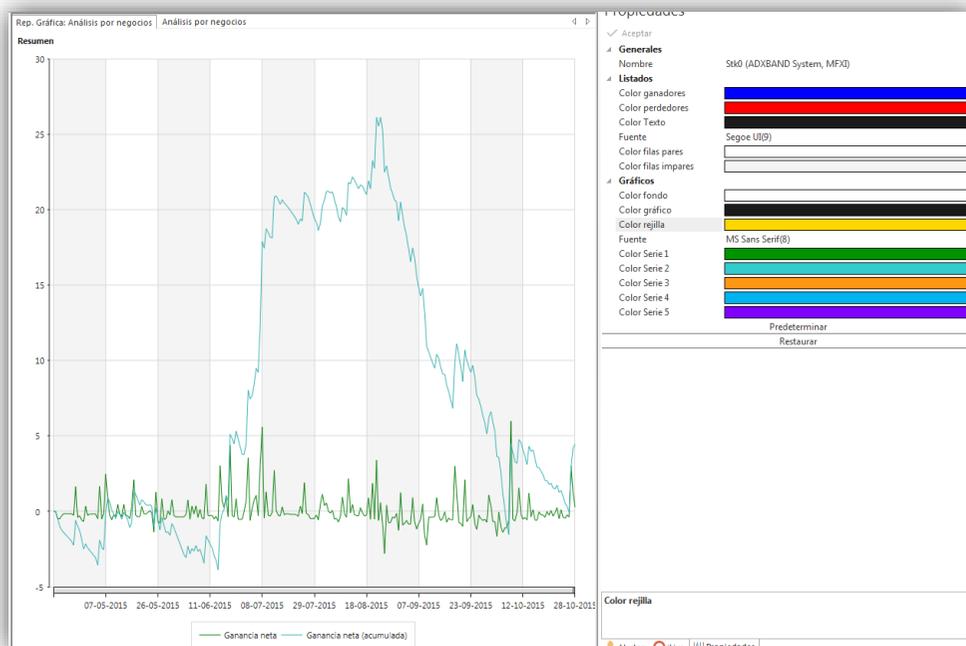
## Actuaciones sobre las estadísticas de un sistema

En el menú Estadística existe un comando denominado **Mostrar Huecos**. Accionando sobre él, se muestran en el gráfico estadístico, todos los días, semanas, meses o años (al utilizar una compresión) independientemente de que haya datos o no.



El comando **Actualizar** del menú estadística recalcula la misma para reflejar los cambios que se hayan podido producir en los sistemas ( modificación de parámetros, ampliación de histórico en el gráfico....).

## Actuaciones sobre las estadísticas de un sistema



Como en el caso de gráficos, tablas y otros elementos, podemos actuar sobre la configuración de colores y fuente de letra desde el panel de **propiedades**.



visualchart

## Preguntas y respuestas

Manténgase en línea para la sesión de preguntas

Puede realizar sus preguntas a través del chat.

Si desea formular una consulta por voz, pida la palabra al organizador en el chat.





visualchart

Muchas gracias por su asistencia

Si tienen alguna pregunta o sugerencia acerca del contenido de nuestras sesiones  
escriban un email a [formacion@visualchart.com](mailto:formacion@visualchart.com)

Le mantendremos informado sobre  
los próximos seminarios web



# visualchart

La información contenida en este documento ha sido elaborada por Visual Chart Group, y tiene carácter informativo. Su contenido no debe ser considerado como oferta de venta, solicitud de una oferta de compra de ningún producto o servicio de inversión, ni una recomendación o propuesta de inversión personalizada, ni constituye asesoramiento en materia de inversión, ya que en su elaboración no se han tenido en cuenta los conocimientos y experiencia en el ámbito de la inversión correspondiente, o situación financiera o los objetivos de inversión del usuario. Las inversiones a las que se refieren los contenidos de este documento pueden conllevar riesgos significativos, pueden no ser apropiadas para todos los inversores, pudiendo variar y/o verse afectadas por fluctuaciones del mercado el valor de los activos que en ellas se mencionan, así como los ingresos que éstos generen, debiendo advertirse que las rentabilidades pasadas no aseguran las rentabilidades futuras.

En las informaciones y opiniones facilitadas por Visual Chart Group se ha empleado información de fuentes de terceros y han de ser consideradas por el usuario a modo indicativo, sin que pueda estimarse como elemento determinante para la toma de decisiones. Visual Chart Group declina toda responsabilidad por el uso que pueda verificarse de la misma en tal sentido. Visual Chart Group no garantiza la veracidad, integridad, exactitud y seguridad de las mismas, por lo que Visual Chart Group no se responsabiliza de las consecuencias de su uso y no acepta ninguna responsabilidad derivada de su contenido.