

Herramientas de análisis. Estadísticas de sistemas











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

VISUAL CHART | DEPARTAMENTO DE FORMACIÓN



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.





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.







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.





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.





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.

						Análisis de Montecarlo 1				
Rep. Gráfica: Análisis por negocios	Análisis por negocios	Análisis de Montecarlo 1	Rep. Gráfica: Análisis de M	ontecarlo 1			0.001			
Estadísticos disponibles	Estadísticos disponibles Sis		ma Montecarlo			to	0.0000			
1 Ganancia bruta		825,000	000 (-1.039,863; 1.248,263) 104,200		1.248,263) 104,200		0.0009			
2 Ganancia neta		825,000		(-1.039,863; 1	1.248,263) 104,200		0.9008			
3 Serie de pérdidas		-300,000		(-6.782,315; 1.9	97,915) -2.392,200					
4 Serie de ganancias		40.250,000	000 (37.204,304; 44.983,696) 41.094,000		33,696) 41.094,000		0.0007			
5 Peor serie de pérdidas		-6.900,000		(-12.101,795; -4.0	49,405) -8.075,600					
6 Mejor serie de ganancias	Rep. Gráfica	: Análisis por negocios 🛛 A	nálisis por negocios An	álisis de Montecarlo 1 Rep	. Gráfica: Análisis de Monte	ecarlo /	0.0006			
7 Ganancia neta (select)	Compra	/ Venta Fecha de entra	da Fecha de salida	Punto de entrada	Punto de salida	Gana	0.0005			
8 Ganancia neta (outliers)	1 🚹	27/04/20	015 11:25 27/04/2015	17:15 20.055,00	0 20.115,000					
9 Recta de regresión	2 🛂	27/04/20	015 17:15 27/04/2015	19:25 20.115,00	0 20.110,000		0.0004			
10 Número de barras	3 🛂	28/04/20	015 06:30 28/04/2015	20.080,00	0 20.040,000					
	4 🛂	28/04/20	29/04/2015	07:25 20.010,00	0 19.950,000		0.0003			
	5 🛂	29/04/20	015 14:10 30/04/2015	00:40 19.920,00	0 19.850,000	1	0.0002 -			
	6 🛂	30/04/20	015 01:05 30/04/2015	13:40 19.795,00	0 19.540,000					
	7 🛂	30/04/20	015 17:50 30/04/2015	23:05 19.480,00	0 19.450,000		0.0001			
	8 🚹	30/04/20	01/05/2015	04:45 19.450,00	0 19.495,000					
	9 🚹	01/05/20	015 06:50 04/05/2015	00:50 19.530,00	0 19.715,000	-800 -600 -400 -	200 0 200 4	400 600 800 1000 1200	1400 1600 1800 2000 2200 2400	2600 2800 3000
	10 🛂	04/05/20	015 00:50 04/05/2015	09:35 19.715,00	0 19.705,000			- Ganancia bruta Ganancia neta	Sanancia neta (select)	
	11 💽	04/05/20	015 09:35 04/05/2015	17:40 19.705,00	0 19.745,000	Constants for the			Carlo de exterior	
	12 🛂	05/05/20	015 03:30 05/05/2015	09:20 19.750,00	0 19.735,000	Serie de ganancias		Peor serie de pérdidas	Mejor serie de ganancias	
	13 🛂	05/05/20	015 13:40 05/05/2015	23:25 19.725,00	0 19.415,000	Ganancia neta (select)		Ganancia neta (outliers)	Recta de regresión	
	14 💽	05/05/20	015 23:25 06/05/2015	06:15 19.415,00	0 19.430,000	1.14	10,000			
	15 🛂	06/05/20	015 13:20 06/05/2015	21:00 19.400,00	0 19.335,000	1.20	05,000			
	16 🔼	07/05/20	01516:30 08/05/201	01:05 19.345.00	0 19.355.000	1.21	5 000			





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.





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.

ARCHIV	O ABI	RIR OPERAR	COMUNIDAD	VER	VENTANA	ESTADÍSTICA			
\sim	Intervalo	Intervalo complet	Filtro resultado	Todos		mpresión Negocios	+	🖶 Exportar 🔹	🔿 Actualizar
	Inicio	17/03/2017	Filtro posición	General	-	- Predet	erminar	E Copiar	
Abrir	Fin	11/04/2017	Unidad	Porcentual	-	🔿 Restau	urar	🔤 Mostrar huecos	
Cloud					Estadís	tica			





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

	ι 🍈 🖸	General		
Pega			C 0(m 6	0 00
- cgc	" 💉 🔤			iÕ → Õ
Portap	apeles 🕞	Fuente 🕞 Alineación 🖓	Número	
A1		\cdot : $\times \checkmark f_x$		
	Α	В	с	
1	7 vis	ualchart		
2	vi5			
3				
4		Listado resumen		
5	Grupo	Estadístico	Resultado	
6 R	esumen			
7		Ganancia del mercado	-10,954	
8		Ganancia neta	0,068	
9		Ganancia bruta (Acumulada)	4,539	
10		Ganancia neta (acumulada)	4,539	
11		Comisiones	0	
12		Peor serie de pérdidas	-27,68	
13		Fiabilidad	0,299	
14		Sharpe ratio	10,621	
15		Número de negocios	261	
16		Negocios por año (Tiempo total)	520,11	
17		Negocios por días (Tiempo total)	1,425	
18		Número de contratos/acciones (Máximo)	1	
19		Información del sistema	n/a	
20 R	entabilidad			
21		Ganancia bruta (Acumulada)	4,539	
22		Ganancia neta (acumulada)	4,539	
23		Ratio: Comisiones acumuladas / Ganancia neta acumulada	0	
24		Ganancia por ano (Tiempo total)	9,045	
25		Ganancia por mes (Tiempo total)	0,743	
20		Ganancia por ula (Tempo total) Moior grupo do continuidad	0,025	
27		Mejor serie de ganancias	8,08	
20		Acumulado	30,014	
20		Acumulauo	3,203	
29 30 P	iesnes			

ARCHIVO	INICIO IN	ISERTAR	DISEÑO DE PÁGINA	FÓRMULAS	DATOS	REVISA
📸 🕹 🖒	ortar	Calibri	- 11 - A	· . = = =	87-	F Ajust
Pegar	opiar 👻	N K	s - III - (ð -	A . = = =	- 	E Com
÷ 🔨 C	opiar formato					E com
Portapa	ipeles	G	Fuente	E.	Aline	ación
A1			$\checkmark f_x$			
A		В	С	D	E	F
	visualc	hart				
3			A (11-1			
4			Analisis po	or negocio	IS	
5	18000	1				
6	16000	-				-
7	14000	1				
8	12000	-	Concession of the local division of the loca	and the second s		
9	10000	-	-		No. of Concession, name	
10	6000]				
1	4000	_				
.2	2000	-				
1.3	0		-			
14	-2000	-				
16	-4000					
17		010	010010	010	010	010
8		04/2	05/2 06/2 06/2 07/2	07/2008/2008/2009/2009/2009/2009/2009/2009	7/60 2/60 2/60	10/2
.9		28/ 30/ 05/ 15/	28/ 28/ 11/ 23/ 11/ 11/	21/12/22/22/22/22/22/22/22/22/22/22/22/2	15/12/22	08/ 15/
20						
21						
22						
22						
2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2						
22 23 24 25 ompra /	Vent Fecha	de entrada	Fecha de salida II	nto de entra un	o de salidin	cia del r
22 23 24 25 <mark>ompra /</mark> 26 V	Vent Fecha 28/04	de entrada /2015 12:39	Fecha de salida 11 28/04/2015 15:04	nto de entra un 11573	to de salidin 11571	cia del r 0,0
22 23 24 25 ompra / 26 V 27 C	Vent Fecha 28/04, 28/04,	<mark>de entrada</mark> /2015 12:39 /2015 15:04	Fecha de salida u 28/04/2015 15:04 28/04/2015 16:04	nto de entra un 11573 11571	to de salidin 11571 11517	cia del r 0,i -0,
22 23 24 25 ompra / 26 V 27 C 28 V	Vent Fecha 28/04, 28/04, 28/04,	de entrada /2015 12:39 /2015 15:04 /2015 16:04	Fecha de salida u 28/04/2015 15:04 28/04/2015 16:04 29/04/2015 09:04	nto de entra un 11573 11571 11517	to de salidan 11571 11517 11574	cia del r 0,1 -0,2 -0,1
12 13 14 15 ompra/ 16 V 17 C 18 V 19 C	Vent Fecha 28/04, 28/04, 28/04, 29/04,	de entrada /2015 12:39 /2015 15:04 /2015 16:04 /2015 09:04	Fecha de salida u 28/04/2015 15:04 28/04/2015 16:04 29/04/2015 09:04 29/04/2015 09:04	nto de entra un 11573 11571 11517 11574	to de salidin 11571 11517 11574 11540	cia del r 0,1 -0,2 -0,1 -0,1
22 23 24 25 ompra/ 26 V 27 C 28 V 29 C 30 V	Vent Fecha 28/04, 28/04, 28/04, 29/04, 29/04,	de entrada /2015 12:39 /2015 15:04 /2015 16:04 /2015 09:04 /2015 09:24	Fecha de salida 28/04/2015 15:04 28/04/2015 16:04 29/04/2015 09:04 29/04/2015 09:04 29/04/2015 09:24 29/04/2015 10:09	nto de entra un 11573 11571 11517 11574 11540	to de salidin 11571 11517 11574 11540 11557	cia del r 0,1 -0,1 -0,1 -0,1 -0,3
22 23 24 25 ompra/ 26 V 27 C 28 V 29 C 30 V 31 C	Vent Fecha 28/04, 28/04, 28/04, 29/04, 29/04, 29/04, 29/04,	de entrada /2015 12:39 /2015 15:04 /2015 16:04 /2015 09:04 /2015 09:24 /2015 10:05	Fecha de salida 28/04/2015 15:04 28/04/2015 16:04 29/04/2015 09:04 29/04/2015 09:04 29/04/2015 09:04 29/04/2015 10:09 29/04/2015 11:14	nto de entra un 11573 11571 11517 11574 11574 11540 11557	to de salidin 11571 11517 11574 11540 11557 11540	cia del r 0,1 -0,1 -0,1 -0, -0, -0,
22 23 24 25 ompra / 26 V 27 C 28 V 29 C 30 V 31 C 32 V	Vent Fecha 28/04, 28/04, 28/04, 29/04, 29/04, 29/04, 29/04, 29/04,	de entrada /2015 12:39 /2015 15:04 /2015 16:04 /2015 09:04 /2015 09:24 /2015 10:09	Fecha de salida u 28/04/2015 15:04 29/04/2015 16:04 29/04/2015 09:04 29/04/2015 09:04 29/04/2015 10:09 29/04/2015 11:14 29/04/2015 11:34	nto de entra un 11573 11571 11517 11574 11574 11540 11557 11540	to de salidin 11571 11517 11574 11540 11557 11540 11557	cia del r 0,0 -0,5 -0,0 -0,5 -0,5 -0,5



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







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....).







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**.





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.





Muchas gracias por su asistencia

Si tienen alguna pregunta o sugerencia acerca del contenido de nuestras sesiones escriban un email a <u>formacion@visualchart.com</u>

> Le mantendremos informado sobre los próximos seminarios web



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.



VISUAL CHART GROUP | c/ Chillida, 4 · Planta 4a · 04740 · Roquetas de Mar · Almería