

Workshop Performance Decay

Bologna 15-16 Dicembre 2018

I docenti

Andrea Angiolini
Francesco Placci

Email

angiolini@algoritmica.pro
placci@algoritmica.pro

Informazioni Generali

Descrizione

Corso dedicato all'approfondimento dei migliori filtri di Performance Decay e all'impiego un ranking di portafoglio dei sistemi di trading. Nessun sistema dura in eterno e le fasi negative fanno parte della vita di ciascun trading system. Durante il corso si verranno affrontati i limiti delle piattaforme di trading e verrà chiarito come sia stato possibile sviluppare un tool, per Multicharts e Tradestation, che è in grado di inibire e riattivare l'operatività di un sistema di trading in automatico, sulla base di criteri oggettivi che dipendono dalle performance del sistema stesso.

Obiettivi del corso

Divulgare ai partecipanti i criteri di implementazione dei filtri di Performance Decay e di Ranking di Portafoglio per una totale e autonoma gestione delle fasi di Backtest e Automatizzazione degli stessi.

Il Programma

Giorno 1	Relatore	Reading
09:30am - 11:00am	Andrea Angiolini	<ul style="list-style-type: none"> - Presentazione del corso. - Lo stato dell'arte. - Il decadimento temporale. - Il ranking di portafoglio.
11:00am - 13:00pm	Francesco Placci	<ul style="list-style-type: none"> - Analisi di un portafoglio di sistemi. - Performance Decay vs Ranking di Portafoglio. - Portafoglio originale vs Portafoglio con filtri e ranking. - Valutazione della fase out-of-sample con la WFA.
14:00pm - 16:30pm	Andrea Angiolini	<ul style="list-style-type: none"> - Spiegazione tecnico-pratica sull'utilizzo dei codici. - Come impostare un sistema personalizzato. - I significati degli inputs per lanciare un'ottimizzazione. - L'utilizzo dell'indicatore nel grafico automatizzato.
16:30pm - 18:00pm	Francesco Placci	<ul style="list-style-type: none"> - Esercitazione su MultiCharts per trovare il filtro migliore attraverso le aree di stabilità. - Perché ottimizzare un filtro di Performance Decay? - Quale è la significatività statistica del filtro?

Giorno2

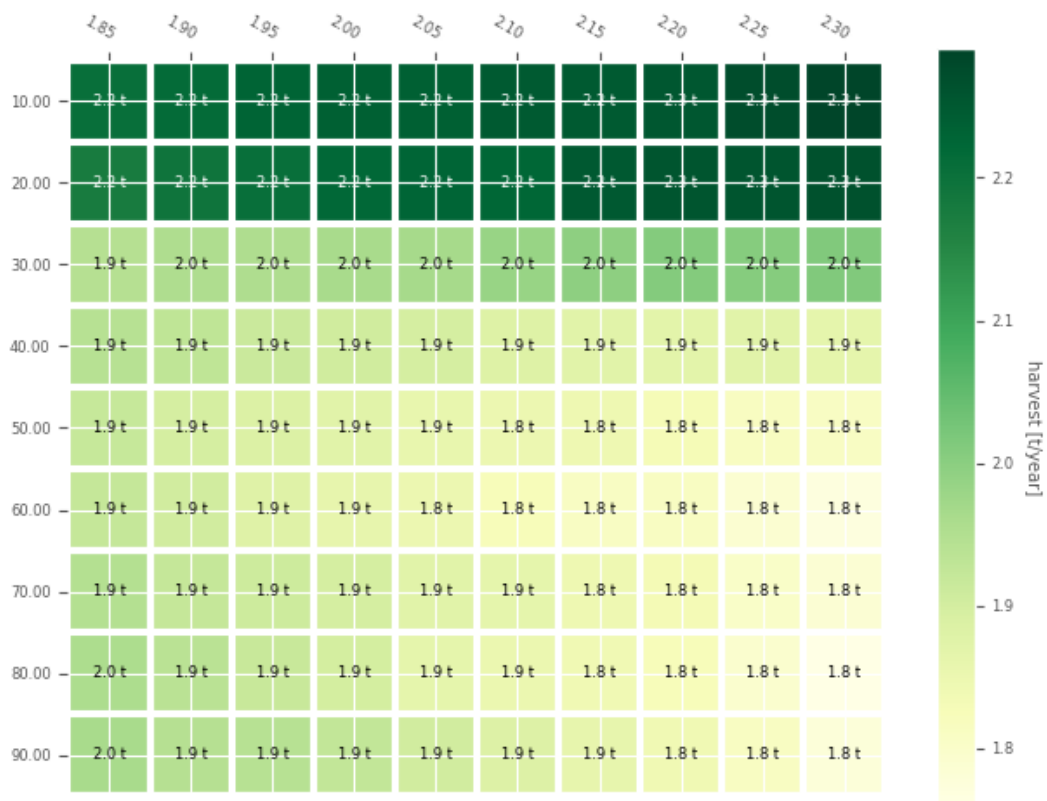
Relatore

Reading

09:30am - 11:00am	Francesco Placci	<ul style="list-style-type: none"> - Spiegazione tecnica dei filtri presenti nel Validator. - Perché utilizzare il Validator per ottimizzare i filtri? - Come leggere l'heatmap del Validator.
11:00am - 13:00pm	Andrea Angiolini	<ul style="list-style-type: none"> - Esercitazione con il Validator per trovare il filtro migliore attraverso le aree di stabilità. - L'ottimizzazione in MultiCharts per il Validator. - Come validare un filtro di Performance Decay?
14:00pm - 16:30pm	Francesco Placci	<ul style="list-style-type: none"> - Un portafoglio di sistemi già integrati con i filtri. - Analisi del sistema chiavi in mano.
16:30pm - 18:00pm	Andrea Angiolini	<ul style="list-style-type: none"> - Costruzione del portafoglio in MultiCharts con i filtri individuati tramite il Validator. - Come automatizzare il portafoglio con particolare attenzione all'utilizzo delle multi-istanze della piattaforma

Le funzionalità del Validator

Heat Map



Riepilogo dell'ottimizzazione

Equities Optimization Results

	Data	Value	Description
[-] Equity Average	% Improvement PF	67.00%	Improvement of Profit Factor compared to benchmark
	% Improvement DD	67.10%	Improvement of Drawdown compared to benchmark
	Best Values	long='50.00',short='20.00'	Parameters that gave best results
[-] Average Trade	% Improvement PF	18.15%	Improvement of Profit Factor compared to benchmark
	% Improvement DD	45.26%	Improvement of Drawdown compared to benchmark
	Best Values	AT='529.00',period='10.00'	Parameters that gave best results
[-] Profit Factor	% Improvement PF	24.19%	Improvement of Profit Factor compared to benchmark
	% Improvement DD	61.60%	Improvement of Drawdown compared to benchmark
	Best Values	PF='2.30',period='10.00'	Parameters that gave best results
[-] Percentage Profitable			
	% Improvement PF	0.00%	Improvement of Profit Factor compared to benchmark
	% Improvement DD	0.00%	Improvement of Drawdown compared to benchmark
	Best Values	PP='0.41',period='30.00'	Parameters that gave best results

FAQ sull'evento

Il corso verrà ripetuto?

No, al contrario degli altri percorsi formativi di Algoritmica.pro, questo workshop è una edizione unica.

Che livello di esperienza è richiesto?

Consigliamo il workshop a trader che abbiano un minimo di esperienza con l'uso della piattaforma MultiCharts o Tradestation.

Utenti MultiCharts e clienti Tradestation

Per essere ammessi a partecipare al workshop è necessario essere in possesso di una licenza originale del software MultiCharts e/o di un codice utente valido per la piattaforma Tradestation.

I codici della libreria che gestisce la Performance Decay saranno aperti?

No, i codici della libreria che gestisce all'interno delle piattaforme (MultiCharts e Tradestation) la Performance Decay e il Ranking di Portafoglio verranno forniti sotto licenza d'uso a vita. Per questo motivo è necessario essere in possesso di una licenza valida di MultiCharts o di un codice utente valido per Tradestation.

Se i codici della libreria sono chiusi come potrò personalizzare i miei sistemi?

Una funzione chiusa o protetta consente di essere richiamata in codici aperti. Per questo motivo durante il workshop vedremo tutta la procedura per integrare la libreria di Performance Decay e Ranking di Portafoglio all'interno di un sistema di trading.

Il codice del trading system incluso è aperto?

Sì, il codice del sistema incluso nel workshop è aperto (open source), senza alcuna protezione.

Mi fornirete una licenza d'uso del Validator?

Tutti i partecipanti riceveranno una licenza a vita del software Validator comprensivo del modulo di Performance Decay con HeatMap ed ottimizzazione dei filtri.

Ci sono delle limitazioni con Tradestation?

I codici forniti sono compatibili al 100% con la piattaforma Tradestation, tuttavia trattandosi di una piattaforma a 32 bit esiste un limite fisico dato dal software per il caricamento dei segnali in un'unica istanza. In MultiCharts (piattaforma a 64 bit) ad esempio, al raggiungimento del limite fisico di caricamento dei grafici, è possibile aprire una seconda istanza per caricare altri grafici e sfruttare appieno la RAM disponibile.

Avete una convenzione con qualche hotel per il soggiorno durante il corso?

Sì, contestualmente all'iscrizione verranno fornite tutte le informazioni logistiche per arrivare e soggiornare durante il periodo del corso.

Nel caso rimanessero dubbi relativamente alla operatività successivamente al corso esiste un qualche tipo di supporto?

Sì, abbiamo previsto un apposito canale tematico tramite la piattaforma di messaggistica Slack in cui sarà possibile chiarire eventuali dubbi e seguire l'evoluzione dello studio.

A chi posso chiedere per maggiori informazioni?

Chiamare Algoritmica.pro al 051 3760999 oppure scrivere a info@algoritmica.pro