

Seminario 4

Gestión Monetaria (Money Management)

Fecha: sábado 30 de enero, 2021

Horario: de 10:00 a 14:15

Duración: 4 horas.

PONENTE:

JAVIER ROMERO

Certified Financial Technician (CFTe), Máster en Mercados Financieros e Inversiones Alternativas (MFIA)". "Licenciado en Administración y Dirección de Empresas" por la Universidad Europea. "Máster en Mercados Financieros" por la Universidad San Pablo CEU, y "Especialista en Gestión de Carteras y Productos Derivados" por el Instituto BME

Trader independiente. Socio Fundador de "Optimo Trade Formación S.L.". Experto en diseño de "técnicas de trading" y "técnicas de gestión monetaria y risk management". Codirector del Curso "Análisis & Trading Profesional" del Instituto BME. Ha impartido cursos en entidades financieras como Credit Suisse, Caja Madrid Bolsa, Banesto Bolsa y BNP Paribas. Ha sido Supervisor de Mercado en Meff (BME) y Analista Macroeconómico en Merrill Lynch (London).

PROGRAMA

Módulo 1. Money Management. Conceptos clave:

- ¿Qué es el money management?
- La importancia del money management.
- El Experimento de Ralph Vince.
- La importancia del comienzo. El apalancamiento asimétrico.
- La esperanza matemática / Pay off
- Probabilidad de ruina -risk of ruin-.
- Estrategias martingala versus anti-martingala.

Módulo 2. Estrategias de money management:

- Fixed Fractional o Fixed Risk.
- Regla del 2% (Alexander Elder).
- Fórmula de Kelly.
- Fixed Ratio.
- Profit Risk Method.

Módulo 3. Elaboración de un "diario de trading/operaciones":

- ¿Por qué se necesita un "diario de *trading*"?
- Partes que forman un "diario de *trading*":
 - o 1º Parte: plan de trading.
 - o 2º Parte: diario de operaciones.
 - o 3º Parte: conclusiones.