

Javier Rincón Miranda

*Director de Trading Algorítmico
Acciones & Valores,
Colombia*





**Acciones
& Valores**
*Comisionista de bolsa
Desde 1959*

Trading Algorítmico: Un vistazo

Javier Andrés Rincón

Director Trading Algorítmico

Índice

1. Introducción
2. Panorama Global
3. Panorama Local
4. ¿Hacia dónde vamos?

Introducción

algorithm

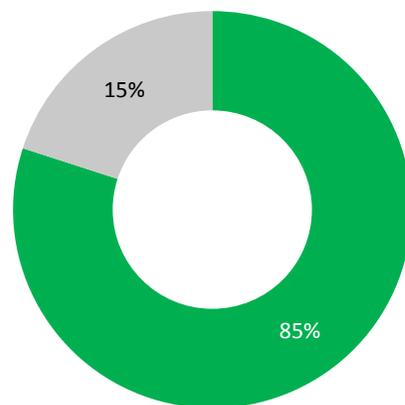
noun

Word used by programmers when they do not want to explain what they did



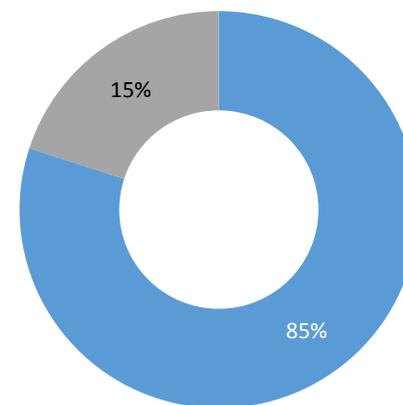
Panorama Global

- ✓ En 2003 el trading algorítmico representaba tan solo un 15% del volumen total operado
- ✓ En 2013 representaba 70% más que en 2003



■ Trading Algorítmico

2003



■ Trading Algorítmico

2013



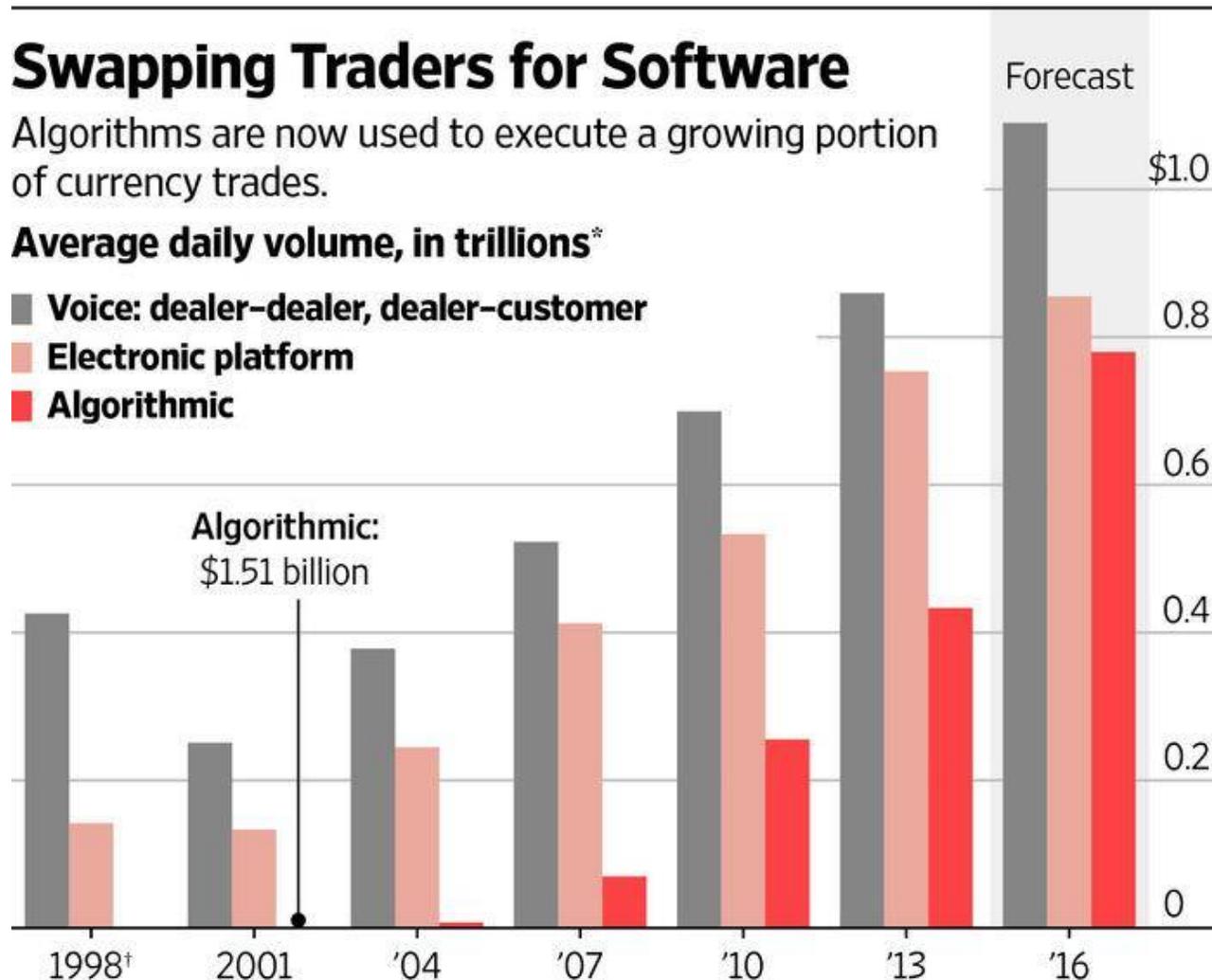
Panorama Global

Swapping Traders for Software

Algorithms are now used to execute a growing portion of currency trades.

Average daily volume, in trillions*

- Voice: dealer-dealer, dealer-customer
- Electronic platform
- Algorithmic



*Spot-market trades †Algorithms weren't used in 1998.

Sources: GreySpark's surveys and analysis of Bank for International Settlements data

THE WALL STREET JOURNAL.



Panorama Local

Trading Algorítmico

- ✓ Algoritmos de Market Making
 - ✓ Algoritmos de Arbitraje
 - ✓ Algoritmos de Posición Propia
 - ✓ Estrategias de trading y cobertura de riesgo
-
- ✓ Módulos de comunicación con las Bolsas
 - ✓ Plataformas de gestión de activos y portafolios
 - ✓ Data Analytics, Big Data
 - ✓ Automatización del Front y Back Office



Panorama Local

Proveedores de Infraestructura

- ✓ Integraciones de plataforma Renta Variable, Derivados y Renta Fija
- ✓ Protocolo Fix para plataforma interdealer de FX



¿Hacia dónde vamos?

Crowdfunding

- ✓ Quantopian
- ✓ Quantiacs
- ✓ Numerai



Quantopian



NUMERAI

Creación de Algoritmos

Inteligencia Artificial

- ✓ Ejecución de órdenes
- ✓ Estrategias basadas en Machine Learning
- ✓ Estrategias cuantitativas



Conclusiones

You cannot invent an algorithm that is as good at recommending books as a good bookseller

John Green



Bogotá: Calle 72 # 7-64, Piso 11

Tel: 325 7800

Cali: Av.8 norte 25N-14,P.1 Ed. Spectra

Tel: 489 9898

Línea Nacional: 01 8000 111 700

www.accivalores.com

 /company/acciones-y-valores-s-a

 /accionesyvalores

 /accionesyvalores

 /accivalores

