



## ESTRATEGIA CON TURNAROUND

## Aprovechando de los movimientos tendenciales

Los traders que operan a favor de la tendencia, buscan aprovechar al máximo los movimientos de explosión. Tratan de entrar en el punto más bajo posible para compras y lo más cercano a la cumbre para ventas. En este afán por situarse en la cabeza de la carrera, muchas veces la precipitación es la protagonista.

En la estrategia que planteo a continuación, tratamos de aprovechar al máximo los movimientos tendenciales mediante un indicador propio, creado por mí en el año 2009 y al que llamamos TURNAROUND (traducido literalmente sería como "giro de vuelta").



### Jose Martínez

Jose Martínez. Trader a tiempo completo desde el año 2003. Máster en gestión financiera y Bolsa, diplomado en gestión de carteras y Day Trading. Fundador de los proyectos trading12.com y formandotraders.com. Actualmente en proceso de obtención de la certificación CFTe  
✉ info@formandotraders.com

Este indicador trata de señalarnos las reversiones importantes, es decir, no deseo que me avise de cada cambio de dirección del mercado pero sí que lo haga a cada cambio de onda. Esto puede parecer abrasador y poco efectivo pero tengamos en cuenta que no es lo mismo un giro de onda en marcos temporales de 1 minuto que en cuadro diario o semanal. Está claro que el spread juega un papel importante en el aprovechamiento de los movimientos tendenciales.

### Indicaciones

Para que lo entiendan mejor les presento a modo visual, como se ven las indicaciones en una gráfica del índice DAX. Cabe destacar que el indicador funciona exactamente igual en cualquier activo ya que una de las variables principales es determinar mediante un algoritmo cuánto ha corregido un activo respecto a un número determinado de sesiones.

## No es lo mismo un giro de onda en marcos temporales de 1 minuto que en cuadro diario o semanal.

Además tiene la ventaja de que cuando el activo en el que lo tenemos implantado cambia de tendencia, nos avisa mediante una ventana como la que muestra la imagen anterior, señalando el activo en el que se produce el cambio y la temporalidad. De este modo podemos implantarlo en todos los activos que deseemos y en distintas temporalidades y mientras trabajamos en cualquier otra cosa, el indicador nos avisará cuando se produzca un cambio importante. Pero claro, si le disparamos a todas y cada una de las señales corremos con el riesgo de operar muchas veces en contra de la tendencia y nosotros queremos aprovechar los movimientos tendenciales al máximo. ¿Cómo podemos entonces identificar la tendencia principal en una temporalidad determinada y seguir las señales que van acorde a ella?

### Aplicando los filtros

Ante este problema, decidimos colocar una serie de filtros. Por un lado necesitamos identificar exactamente, que es lo que queremos:

1. Identificar las tendencias y operar a favor de ellas
2. Conocer el punto exacto donde entrar y donde salir con Stops y Take profits

Así que decidí colocar un indicador muy sencillo, que identificase las tendencias. Después de realizar muchas pruebas, escogí para todos los marcos temporales una Media Móvil Exponencial de 200 periodos. Esta media me iba a imposibilitar aprovechar el movimiento al máximo (comprar cerca de mínimos y vender cerca de máximos) pero por lo menos las señales que se dieran dentro de

### G1 DAX30



El indicador TURNAROUND nos muestra los cambios de tendencia más importantes.

Fuente: [www.formandotraders.com](http://www.formandotraders.com)

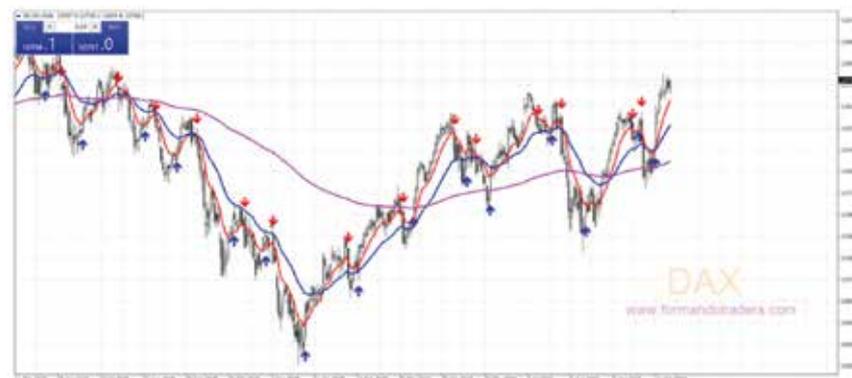
### G2 DAX 30



Turnaround con filtro de Media móvil Exponencial calculada al cierre.

Fuente: [www.formandotraders.com](http://www.formandotraders.com)

### G3 DAX 30

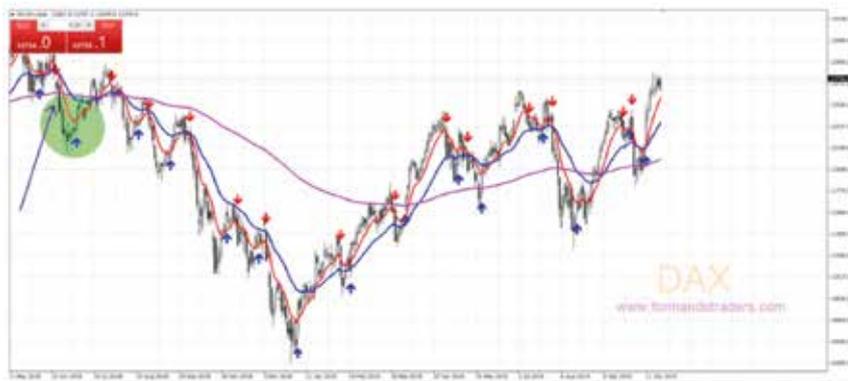


Ahora las medias cortas nos ayudarán a determinar el punto de salida.

Fuente: [www.formandotraders.com](http://www.formandotraders.com)

## Después de realizar muchas pruebas, escogí para todos los marcos temporales una Media Móvil Exponencial de 200 periodos.

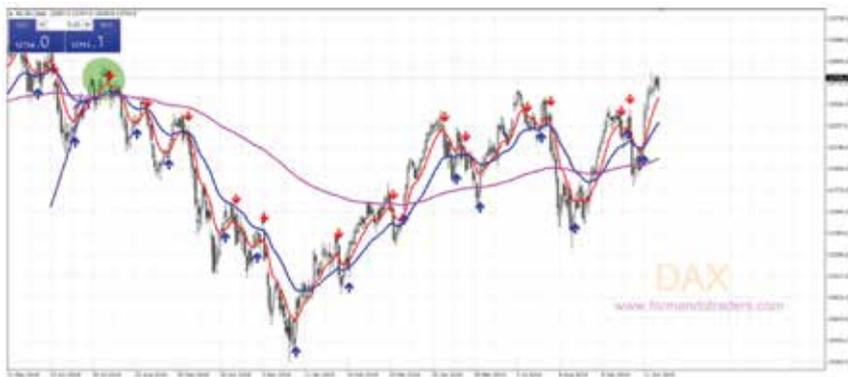
### G4 DAX30



Desarrollo de la estrategia TURNAROUND identificando las tendencias.

Fuente: [www.formandotraders.com](http://www.formandotraders.com)

### G5 DAX 30



Desarrollo de la estrategia TURNAROUND identificando las tendencias.

Fuente: [www.formandotraders.com](http://www.formandotraders.com)

### G6 DAX 30



Identificando las señales adecuadas en función de la posición del precio con respecto a su EMA 200.

Fuente: [www.formandotraders.com](http://www.formandotraders.com)

esta, serían más fiables. La visión de la estrategia ahora sería así como la que en Gráfico 2.

Con esta configuración ya podemos operar teniendo en cuenta que disponemos:

1. De un sistema que nos indica cuando existe una reversión más o menos importante
2. Que dicha reversión se encuentra alineada con la tendencia principal del activo en una temporalidad determinada
3. De una zona específica (cruces de media móviles cortas) para salir con beneficios.

### ¿Cómo function todo?

Y ahora viene la respuesta a la pregunta ¿Cómo se opera realmente con este sistema?

Primero de todo aclarar que se puede operar de 3 formas. En este artículo me voy a centrar en la más eficiente según los backtestings realizados durante todos estos años y después comentaré por encima las otras dos.

1º- Una vez que se genera la señal de entrada (Compra o venta) en el activo, compruebo si dicha señal está alineada con la tendencia. Si es señal de compra deberá estar situado el precio por encima de la media móvil de 200 periodos y por debajo en el caso de ventas.

2º- Si es así tomo la posición e inmediatamente después la protejo colocando el stop de pérdidas por debajo del mínimo anterior si se trata de una compra y por encima del máximo anterior si se trata de una venta.

3º- Salgo de la operación cuando se cruzan las medias móviles cortas (10 y 30 periodos) en sentido contrario a la dirección principal.

## Las otras dos variantes de la estrategia varían en función de la salida pero los parámetros de entrada se respetan.

Veamos un ejemplo tomando como referencia las imágenes anteriores en el Gráfico 4.

Como podemos apreciar en la imagen el precio cruza la media de 200 periodos hacia abajo, con lo que debo estar alerta para seguir únicamente las señales BAJISTAS (en este caso las flechas rojas), pero no se da ninguna con lo que olvido de posicionarme en el mercado.

En la imagen 5 y continuando con el proceso, el precio rompe hacia arriba la media de 200 periodos con lo que esperaré una señal alcista para entrar con una operación. Tampoco se presenta dicha señal con lo que me olvido de entrar en ninguna operación.

### G7 Rentabilidad



Rentabilidad de la estrategia en el periodo comprendido entre enero y octubre de este año 1056%.

Fuente: [www.formandotraders.com](http://www.formandotraders.com)

### Instantánea de Estrategia

<b>Nombre de la estrategia:</b>	Turnaround
<b>Tipo de estrategia:</b>	Seguimiento de tendencias
<b>Horizonte temporal:</b>	Válido para todos los marcos temporales
<b>Configuración:</b>	Largos, si el precio se sitúa por encima de la EMA 200 y obtenemos señal del indicador. Cortos si el precio se sitúa por debajo de la EMA 200 y obtenemos señal del indicador.
<b>Entrada:</b>	Componentes discrecionales. Detallados en SETUP
<b>Límite de pérdidas:</b>	Para compras situamos el Stop por encima del máximo anterior. Para ventas lo situamos por debajo del mínimo anterior
<b>Toma de beneficios:</b>	Recogemos beneficios cuando se crucen las EMAS 10 y 30 en sentido contrario
<b>Salida parcial:</b>	No
<b>Salida:</b>	Salida por alcance de beneficios o pérdida asumida
<b>Gestión de riesgo y beneficios:</b>	Buscamos ratios mínimos de 2:1
<b>Promedio de señales:</b>	Depende del marco temporal utilizado. Varía bastante
<b>Promedio hit rate/ profit to loss/ return per month etc.:</b>	Retorno por mes: 28%, drawdown en 9 meses= 11,16%, 292 operaciones de compra y 414 de venta. 635 operaciones ganadoras (90%) y 71 perdedoras (10%)

En el gráfico 6 vemos de nuevo como el precio vuelve a romper hacia abajo la EMA 200 así que espero una señal bajista (flecha roja) para posicionarme. Tal y como muestra el círculo verde, la señal aparece y abro una posición de venta. Me protejo ligeramente por encima del máximo anterior. La salida viene determinada en este caso por el cruce de las medias móviles de 10 y 30 periodos. Podemos ir añadiendo posiciones a la estrategia mientras no exista ningún cruce de medias cortas. Salir de todas las posiciones en cuanto se dé el primer cruce.

### Más variantes

Las otras dos variantes de la estrategia varían en función de la salida pero los parámetros de entrada se respetan. Podemos salir cuando el precio supera en sentido contrario la EMA 200 pero esto hace que muchas operaciones pierdan gran parte de lo ganado y la otra variante es asumir solamente la primera de las señales que se da a favor de la tendencia maximizando las probabilidades de éxito. A continuación en gráfico 7 mostramos los resultados de la estrategia en un backtesting sobre el DAX desde el día. 2 de Enero de 2019 hasta la fecha actual en el 17 Octubre de 2019. La prueba se realiza con un depósito de 1.000€. La rentabilidad diaria es de un 0,85%, la mensual de un 28,60% y la total del periodo de 9 meses es de 1.056%.

El mayor Drawdown es del 11,37% y se termina con un balance de 11.600 €