



ESTRATEGIA PARA FASES DE APERTURA

Técnica de Trading “Coffee Box”

El nombre hace referencia a la hora en la que se genera la caja o Box de volatilidad en la que se sustenta este modelo de entrada al mercado. En la apertura de la sesión europea debemos tener en cuenta la volatilidad de una parte de la sesión asiática y en la apertura de la sesión americana debemos tener en cuenta la volatilidad de una parte de cotización de las bolsas europeas.

Por todos es conocido, que en las aperturas de los mercados europeo y americano se produce un fuerte aumento de volatilidad y que las primeras horas de sesión son las más movidas y divertidas y en las que podemos encontrar oportunidades de negocio. También es sabido por todos, que en el intermedio de la sesión de bolsa

Europa y americana esa volatilidad disminuye y será justo ese momento cuando crearemos el cajón o box de volatilidad que marcará el desarrollo de la estrategia Coffee Box. Otra de las circunstancias que debemos tener en cuenta es la extrema volatilidad y los movimientos falsos y variables que se producen en los primeros minutos tras la apertura de Londres y New York así que nuestra técnica comenzará a dar señales transcurridos los primeros 30 min de sesión y deberá activar la entrada en un máximo de dos horas y media desde la apertura de mercados. Transcurrido ese tiempo si el activo no rompió el techo o suelo del Box de volatilidad no tomaremos ninguna posición ese día, porque entendemos que el día no es propicio para el trading por su bajo movimiento.

¿Cómo comenzamos a buscar oportunidades de entrada para largos o cortos?

Hagamos un resumen, para operar en Europa debemos crear un cajón de volatilidad teniendo en cuenta las



José Luis García López

Trader profesional y analista bursátil con más de 20 años de experiencia en el sector de la intermediación en Renta Variable. Ha sido gestor de Carteras y Gestor de Sicavs para varias entidades a nivel nacional e internacional. Es Cofundador de EnBolsa.net donde actualmente ejerce su actividad como CEO.

✉ analisis@enbolsa.net

horas más aburridas de la sesión asiática y los primeros 30 minutos de la apertura de Londres. A partir de este momento comenzaremos a buscar una oportunidad de entrada en largos o cortos si se produce la ruptura al alza o a la baja del máximo dejado por ese cajón o box de volatilidad.

Largos: Si el precio rompe y cierra una vela de 5 min por encima del cajón de volatilidad entraremos en posición larga, siempre y cuando la señal de entrada no se produzca en zona Pivot point R2 del día, en cuyo caso descartamos la operación de entrada.

Cortos: Si el precio rompe y cierra una vela de 5 min por debajo del cajón de volatilidad entraremos en posición corta siempre y cuando la señal de entrada no se produzca en zona Pivot point S2 del día., en cuyo caso descartamos la operación.

Stop Loss: Una vez cierre la vela de 5 min por encima del rango alto de la caja entraremos largos y colocamos el stop loss en el mínimo del box creado. La distancia del stop dependerá del rango del cajón y este a su vez dependerá de la volatilidad de la sesión que lo generó.

Objetivo ganancia: El take profit u objetivo dependerá de la volatilidad de la sesión que generó la caja y estará más alejado o cercano dependiendo de la volatilidad que hubiera en el mercado. El objetivo lo vamos a dividir en dos partes para facilitar su negociación.

Objetivo 1: lo colocamos a una distancia igual al 60% del rango de la caja.

Objetivo 2: lo colocamos a una distancia igual al 100% del rango de la caja.

Si la vela de 5 min que genera la señal de entrada, toca el precio del objetivo 1 en su formación, no realizaremos la entrada en esta técnica al cierre de dicha vela.

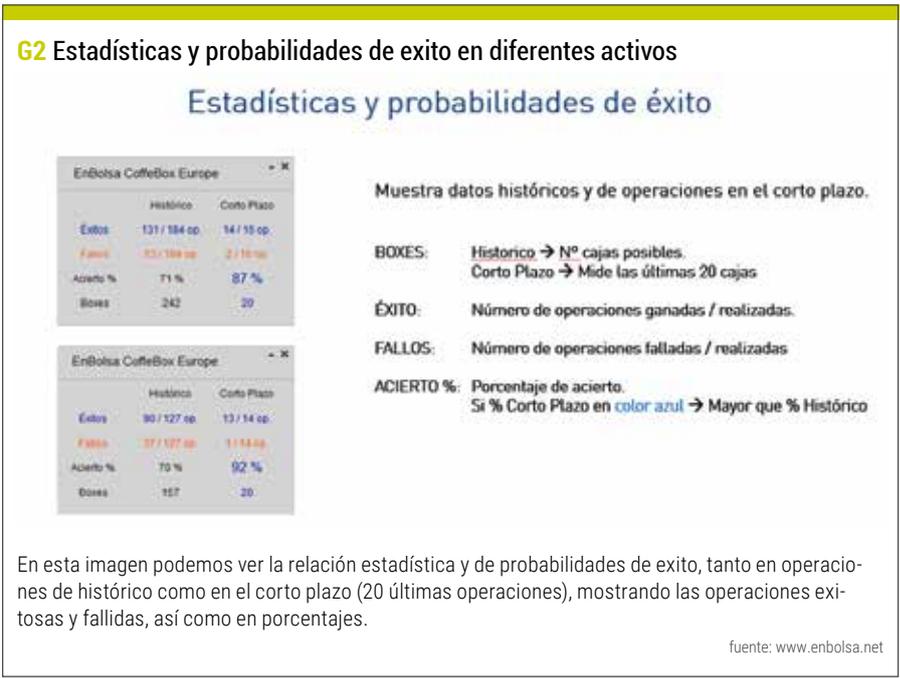
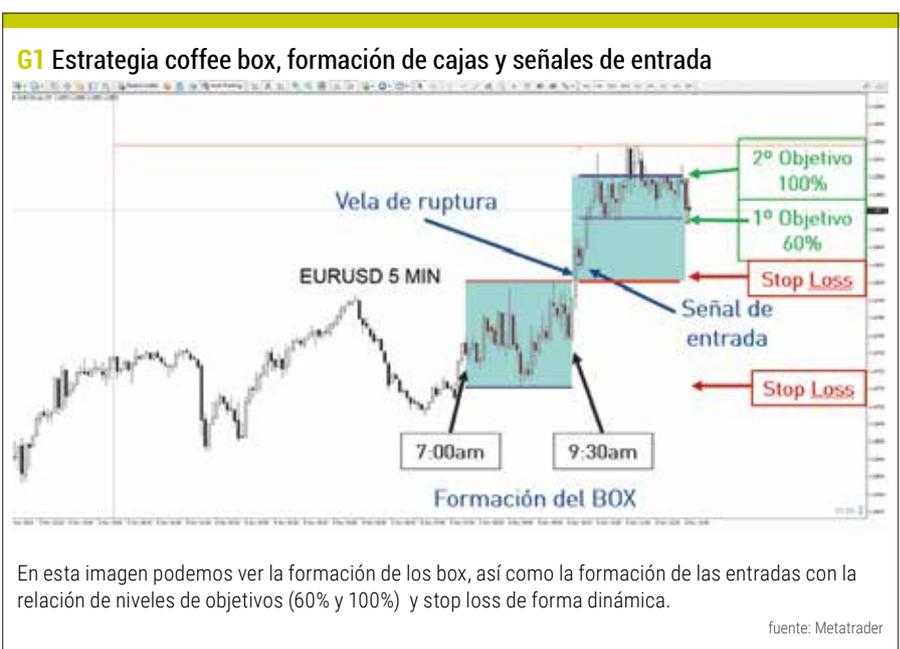
Gestión de stop loss: Cuando el precio alcanza el objetivo 1 procedemos a realizar un cierre parcial

del 50% de la posición y subimos el stop loss al precio de entrada asegurando así una parte del beneficio.

Cuando el precio alcanza el objetivo 2 cerramos el otro 50% y terminamos con la posición total.

Segunda parte de la estrategia: Con las reglas claras

Una vez que tenemos claras las reglas de la operativa del Coffee Box, debemos pasar a una segunda parte del desarrollo de esta estrategia que es muy importante para su perfecto funcionamiento.



Vamos a realizar una búsqueda o escaneo de todos los activos en los que podríamos utilizar esta estrategia de trading y sacamos todos los días en tiempo real la probabilidad de éxito de medio plazo y corto plazo de cada activo en los que hemos elegido abrir la posibilidad de operar.

El estudio de medio plazo los realizamos sobre las operaciones ralladas por Coffee Box en los últimos 6 meses y para el corto plazo utilizamos los últimos 20 días de operativa o lo que es lo mismo, el último mes de operaciones realizadas. De esta forma, podemos saber de entre los activos seleccionados en nuestro panel de estudio, cuales son aquellos en los que funciona mejor este modelo de trading y operar solo los activos en los que su curva de equity o curva del dinero está favorable y ascendente.

El requisito que exigimos en el tramo de probabilidad es que la tasa de acierto de corto plazo sea mayor que la tasa de éxito de medio plazo y además seleccionamos solo aquellas tasas de éxitos de medio plazo que están por encima de la media, así nos aseguramos de operar las mejores rachas de los mejor activos.

Los activos que aparezcan en la tabla en color verde son aquellos que presentan unas probabilidades de éxito muy alta, los activos que parecen en el screener de la técnica en color amarillo es porque presenta una tasa de éxito buena y los de color blanco son los activos menos interesantes para operar esta estrategia de trading.

G3 Screener de búsqueda de señales por tecnica coffee box

Estadísticas Europa			Estadísticas Usa		
Simbolo	% 20 boxes	% Histórico	Simbolo	% 20 boxes	% Histórico
GBPJPY.raw	83.3% 1500	73.2% 82100	EURAUD.raw	85.7% 1400	74.8% 71803
USDCHE.raw	85.0% 1800	73.5% 83903	GOLD	85.7% 1800	71.2% 85483
GBPCAD.raw	84.2% 1800	77.9% 77893	EURUSD	84.6% 1300	74.8% 71091
EURAUD.raw	83.3% 1800	77.9% 77893	EURUSD.raw	85.0% 1500	74.4% 78100
CAC40	82.4% 1700	70.7% 75100	GBPCAD.raw	81.8% 1100	69.6% 56903
USOJPY.raw	81.0% 1800	79.9% 78100	GBPUSD.raw	81.8% 1500	68.9% 61100
ESX50	80.0% 1500	75.0% 80100	AUDJPY.raw	76.8% 1300	75.4% 63891
GBPAUD.raw	78.0% 1800	78.8% 82903	CHFJPY.raw	78.5% 1700	72.0% 74983
GOLD	78.8% 1400	65.3% 7200	NZDJPY.raw	73.3% 1500	74.0% 77893
SP500	77.8% 1800	68.2% 85101	EURJPY.raw	73.3% 1500	70.0% 70000
EURNZD.raw	77.8% 1800	77.8% 85903	CADJPY.raw	71.4% 1400	72.1% 68891
CHFJPY.raw	76.5% 1700	67.5% 82903	GBPAUD.raw	71.4% 1400	70.0% 69893
CADJPY.raw	76.5% 1700	60.5% 75891	USDJPY.raw	71.4% 1400	74.7% 83100
GBPCHE.raw	75.0% 2500	68.4% 78903	ESX50	69.2% 1300	69.4% 72100

Tabla de búsqueda de señales por la tecnica coffee box para los principales activos seleccionados, donde se muestran los porcentajes

fente: www.enbolsa.net

G4 Ejemplo de operación técnica Coffee Box



En esta imagen podemos ver un ejemplo operativo en el USDJPY, donde vemos la plantilla configurada con la información histórica y a corto plazo, la formación del BOX operativo, así como la señal de entrada junto a niveles de entrada, take profits 1 y 2 y niveles de stop loss.

fente: www.enbolsa.net

Coffee Box

Instrumento:	USDJPY
Configuración:	Buy
Entrada:	4 marzo 2020
Precio entrada:	108.001
Stop Loss:	107.692
Take profit 1:	108.330
Take profit 2:	108.490
Salida:	hasta llegado al objetivo o stop loss
Profit Loss:	ratio 1:1 en TP2

Para operar correctamente esta estrategia sería interesante insertar el indicador Coffee Box en su plataforma de trading y tener activo el escáner de búsqueda de oportunidad con sus resultados estadísticos y actualización en tiempo real ya que esto nos ayudará a ser más rápidos y efectivos en nuestra operativa.