

LA MEJOR FORMA DE OPERAR EL MOVIMIENTO INTRADIARIO DEL MERCADO DE ESTADOS UNIDOS

El trading de éxito

Meir Barak está especializado en trading intradía con acciones estadounidenses. En este artículo describe su enfoque para hacer trading de ruptura, cuáles son los factores que aumentan sus probabilidades de éxito y qué hacer si falla la configuración que estamos operando. También explica qué ocurre ante la posibilidad de que los operadores avanzados entren antes de una ruptura real.

Este artículo describe una estrategia que opera las rupturas intradía en acciones de EE. UU. El análisis y la planificación la haremos en el nivel temporal de 5 minutos. Los operadores de swing trading también podrán ajustar e intercambiar la metodología que explicaremos para usarlo con sus gráficos diarios. El trading de ruptura es una de las estrategias más básicas y de uso común. Con él se intenta sacar provecho, tras entrar al mercado, de un movimiento rápido en la dirección de la ruptura. Es importante destacar que con el fin de aumentar las posibilidades de éxito de tales rupturas dinámicas que siempre deben avanzar en la dirección de la tendencia principal y nunca en la dirección opuesta. Es de destacar que después del movimiento de ruptura, a menudo se observa que se operan mayores volúmenes.

La mecánica de la ruptura

Los movimientos de ruptura ocurren cuando la resistencia (configuración a largo) o las líneas de soporte (configuración a corto) se rompen. En estos puntos, el equilibrio de poder entre los compradores y los vendedores puede disminuir rápidamente, ya que muchos participantes del

mercado se guían por estas marcas técnicas. Las líneas de resistencia y soporte son como una presa que puede retener el agua por algún tiempo, pero que finalmente se rompe bajo la presión de las masas de agua. Desde el punto de vista del autor, las rupturas se basan, en última instancia, en profecías autocumplidas. Sin embargo, ello solo aplica si el movimiento posterior esperado realmente continúa. A menudo la configuración falla y, por lo tanto, se produce una ruptura en falso. Con el fin de reducir la tasa de error, la cual es comparativamente alta, con un rango aproximadamente el 80 %, tenemos que echar un vistazo de más cerca al comportamiento de la acción en el punto de ruptura. Además, nuestra estrategia se basa en garantizar que salgamos lo mejor posible de la operación, incluso si la ruptura falla. Después de todo, una ruptura no significa necesariamente que se produzca una operación perdedora.

Cómo reconocer las rupturas de éxito

Hay algunos criterios que podemos usar para aumentar la probabilidad de una posible ruptura.

1. Duración de la consolidación: Cuanto más tiempo se consolida una acción, más fuerte será la ruptura. La consolidación es, por así decirlo, la fuente de energía de la ruptura. Ello se debe a que cada vez existen más actores del mercado observando dicha configuración y que por ello, responderán a la acción aumentando la presión sobre la presa imaginaria.
2. Volumen de negociación apropiado: si el volumen de una acción es generalmente muy bajo, la liquidez es baja, obtener una ganancia se hace más difícil. Si



Meir Barak

Meir Barak es un trader intradiario profesional, autor y fundador de Trading Rooms en línea Tradenet. Desde 2004, más de 16,000 personas se han formado en estrategias de trading de acciones en Tradenet.

✉ www.tradenet.de

← 22-51
WAL ST

el volumen de negociación es demasiado alto, por otro lado, los movimientos de ruptura serán a menudo demasiado pequeños. Por lo tanto, estamos buscando específicamente acciones con un volumen de negociación de más de un millón de acciones al día, evitando al mismo tiempo las acciones más grandes y más negociadas.

3. Fortaleza de las rupturas: cuanto más fuerte y dinámica ha sido la acción en las rupturas intradías de los últimos días, más atractiva resultará nuestra configuración. Algunas acciones rompen solo en unos centavos, otras en medio dólar o más. Estos últimos son nuestros candidatos preferidos.

Reglas de trading

El punto de entrada para entrar está claro. Compramos un centavo por encima del patrón de consolidación (operaciones a largo) o vendemos un centavo por debajo del patrón de consolidación (operaciones a corto). La entrada se puede hacer por medio de una orden a mercado, para asegurarse de que realmente entra en el movimiento. El autor, sin embargo, prefiere la orden limitada de stop, para evitar una mala ejecución. El límite se pone 3 o 4 centavos por encima o por debajo del punto de rotura. Si opera acciones de bajo volumen, use siempre la orden de stop limitada. Para acciones de gran volumen existe una mayor liquidez. Deberíamos establecer el precio objetivo antes de entrar. Aquí se trata de evaluar hasta qué punto el movimiento de ruptura

G1 Ejemplo Operación prolongada



El gráfico de SunPower (abreviatura: SPWR) muestra una operación de éxito de ruptura intradía. La acción se abrió con un hueco alcista y continuó subiendo hasta nuevos máximos. Después de unos 20 minutos de negociación, se formó una bandera alcista. Junto con la alta tendencia alcista, la ruptura de este patrón fue el punto de entrada. El precio siguió aumentando rápidamente, proporcionando un buen rendimiento hasta el precio objetivo, que estaba 40 centavos más alto.

Fuente: www.tradesignalonline.com

puede mover al mercado. Establecemos esta consideración en centavos y no en porcentajes. Para hacerlo, observamos el mercado en términos de la dirección de su movimiento y su fuerza, para luego analizar el histórico de rupturas previas en los últimos 2 o 3 días, y buscamos la fortaleza o debilidad general de las acciones durante el día de negociación actual del día que se espera la ruptura.

Es positivo que el volumen de negociación sea lo más fuerte posible después de la ruptura. Los traders experimentados siguen al precio después de una ruptura de éxito durante el movimiento adicional, por ejemplo, para poder estimar a partir de la cartera de pedidos, si la dinámica del precio podría llevar al movimiento incluso más allá del objetivo de precio planificado o quizás terminar la operación prematuramente. En general, determinar el precio objetivo es más un arte que una ciencia. Por esta razón, los operadores deberían, en cualquier caso, implementar una toma de beneficios parcial temprana, que representa alrededor de las tres cuartas partes del tamaño de la posición. Un objetivo de beneficio razonable para ello sería de 20 a 40 centavos dependiendo del precio

de las acciones y la situación del gráfico. Para acciones muy caras, la ganancia parcial también puede ser de un dólar o más. La razón principal de la toma parcial de beneficios es obtener operaciones rentables y no devolver la mayoría de las ganancias al mercado. Si la posición parcial restante se sale, todavía tendremos un plus en la cuenta operativa. A veces, sin embargo, esta posición parcial también puede terminar en un movimiento inesperadamente grande y obtener una buena ganancia extra.

Gestión de riesgos

El tamaño de las operaciones no debe ser demasiado grande, pero tampoco demasiado pequeño. Dado que los márgenes de ganancia alcanzables en el trading intradía son comparativamente pequeños y promedian alrededor de 50 centavos, no tiene sentido operar 100 acciones. En este último caso, las tarifas serían demasiado altas y no merecería la pena invertir el tiempo necesario, incluso en un caso en el que obtuviésemos ganancias. Además, siempre se deben negociar más de 100 acciones, lo que significa que, en vista de nuestro beneficio parcial planificado, siempre se deben negociar al menos 400 acciones. Una toma temprana de ganancias se llevaría a cabo con

300 acciones, las restantes se podrían dejar con la esperanza de un movimiento más grande. Si la posición al final del día es muy beneficiosa y no hay fechas trimestrales u otras fechas importantes, la posición también se podría mantener para un movimiento activo. En opinión del autor, los traders deberían operar cantidades fijas, independientemente del precio de sus acciones. Una acción de \$ 20 a menudo hace movimientos de precios fuertes similares a una acción de \$ 50 tras una ruptura de éxito. Operar en cantidades iguales en lugar de usar un enfoque porcentual hace que sea fácil calcular en segundos, o en fracciones de segundo, si la posición está en ganancias o pérdidas para tomar decisiones rápidas. Durante el ajetreo y el bullicio del día, esto puede ser una clara ventaja.

¿Qué pasa si falla la ruptura?

Si el movimiento cae inmediatamente después del intento de ruptura y llega al límite de pérdidas, la posición se cierra con pérdidas. Como regla general, este límite es de 20 a 30 centavos por debajo del precio de entrada. Al autor le gustan los límites mentales, que solo se implementan cuando el nivel de precios ha sido realmente roto. Pero ello requiere disciplina, lo cual es duro para los principiantes al tener que mantener la orden firmemente en el mercado (¡pero cuidado con las acciones ilíquidas!). A menudo, la ruptura solo falla temporalmente sin que se llegue al límite de pérdidas. Aquí puede ser que los grandes actores del mercado estén tratando de sacarnos del mercado. E movimiento esperado aún puede tener lugar durante el movimiento del mercado como un todo o simplemente en la nueva ola de pedidos de acciones. Los operadores deben conocer el volumen de negociación, que generalmente debe aumentar después de una ruptura de éxito. Sin embargo, si pasa mucho tiempo después del primer intento, las posibilidades disminuyen, ya que aparentemente ningún otro participante del mercado está dispuesto a impulsar el movimiento. En este caso, la posición debe cerrarse, lo que generalmente significa que tendrá solo una pérdida moderada.

Compre antes de la ruptura

También es posible que los operadores avanzados entren antes de la ruptura real. Esto es útil si se estima que la probabilidad de una ruptura con éxito sea del 80 % o más. Lo cual crea una mejor relación riesgo/probabilidad (CRR). Para utilizar esta técnica de manera rentable, se debe vigilar de cerca la acción, en minutos y segundos antes de la ruptura. Por cada centavo que la acción se mueve antes de la ruptura, observamos los precios de

Instantánea de Estrategia

Nombre de la estrategia:	ruptura intradía
Tipo de estrategia:	trading de rupturas
Horizonte temporal:	gráfico de 5 minutos
Setup:	ruptura de la consolidación del cuadro técnico teniendo en cuenta el libro de operaciones
Entrada:	1 centavo por encima o por debajo del límite
Límite de pérdidas:	20-30 centavos desde la entrada (límite de pérdidas mental para operadores avanzados)
Toma de beneficios:	toma parcial de beneficios de 20-40 centavos en el 75% (acciones de alto precio de \$ 1 y más), posición restante hasta el final del día, o como operación de swing
Límite de pérdidas deslizante:	stop opcional a la entrada con beneficio significativo
Gestión del riesgo y el dinero:	tamaño fijo de negociación (número de acciones), de al menos 400 acciones y además en grupos de 400
beneficio / riesgo:	1: 1 para toma parcial de beneficios, mucho más alto si la posición residual está en tendencia
Índice de acierto medio:	hasta un 80% para configuraciones con una probabilidad particularmente alta de ruptura

oferta y demanda y los números correspondientes en la cartera de pedidos. Mientras la consolidación esté intacta, la oferta y la demanda estarán en equilibrio, y no tendremos ninguna ventaja para llegar temprano. Pero si el precio se acerca al punto de inflexión, la cartera de pedidos se inclina hacia los compradores y la liquidez del lado del vendedor disminuye, la probabilidad de una ruptura dinámica es alta. Al mismo tiempo, el volumen de negociación antes de la ruptura no debería ser demasiado alto, ya que hablaría a favor de un gran número de manos débiles, que inmediatamente saldrán en la menor corrección. Si se cumplen estas condiciones, debemos aprovechar la oportunidad y la entrada antes de la ruptura real. Se necesita experiencia para reconocer tales situaciones, pero con el tiempo se puede aprender. Sin embargo, este método no es, por supuesto, el Santo Grial, porque incluso esta valoración puede ser incorrecta y la ruptura puede que ni ocurra. Por lo tanto, debe comprar antes de la ruptura solo la mitad del tamaño de la posición planificada y el resto solo en la ruptura real.

Conclusión

La configuración presentada en este artículo es una de las técnicas de negociación más importantes del trading diario y funciona igual de bien para posiciones largas como para las cortas. Los movimientos cortos tienden a ser más dinámicos e ir más rápido, con una operación ligera de 1 o 2 horas. El factor decisivo en el trading de ruptura es la confirmación del movimiento de conexión dinámico dentro de una ventana temporal manejable, ya que de lo contrario la probabilidad de una ruptura falsa aumentará fuertemente. Los traders experimentados podrán mejorar su CRR intentando, como se describe para las situaciones especiales, entrar justo antes

G2 Ejemplo de entrada a corto



Las acciones de IBM abrieron con un hueco bajista después de malas noticias. Cuando el precio rompió por debajo del nivel mínimo de la primera media hora, Meir Barak abrió una posición corta. Dado que la acción tenía un precio elevado, el precio objetivo en este ejemplo se fue a más de 1 dólar de distancia.

Fuente: www.tradesignalonline.com

de la ruptura. En caso de tener ganancias acumuladas podemos aumentar el número de operaciones ganadoras y hacer que la estrategia sea mentalmente más fácil de negociar, tomando necesariamente ganancias parciales.

G3 Pérdida



Este ejemplo de entrada a largo en Golar LNG (abreviatura: GLNG) muestra una operación fallida. La acción se abrió con un hueco alcista y continuó subiendo a nuevos máximos. Luego vino un pequeño declive y de nuevo se produjo un comienzo de apretado nuevo pico diario. Allí, Meir Barak abrió una posición alcista. Inmediatamente después, falló la ruptura, por lo que la posición tuvo que cerrarse relativamente rápido con pérdidas.

Fuente: www.tradesignalonline.com