ESTRATEGIA SIMPLE PARA APROVECHAR LA CAÍDA DE LOS PRECIOS

Operando el DAX a corto

Operar el DAX a corto es un negocio difícil, ya que contradice el sentido común de continuación del movimiento de orden superior. Esta es una de las razones por las que los traders a menudo fracasan al operar el DAX. En este artículo, presentamos una estrategia que le permitirá en ciertas situaciones operar con éxito la caída de los precios del DAX.

Peter Wohlfarth
Peter Wohlfarth es arquitecto y un trader ambicioso que trabaja con algoritmos. Su tiempo libre, lo dedica además de a las carreras de bicicletas, a desarrollar sistemas de trading que él mismo programa e implementa en su cuenta de trading.
✉ rendite@pewo-wert.de

La idea

Para tener éxito con un sistema de trading puramente bajista en el DAX, hay que realizar un análisis del patrón de movimiento. De esta manera observaremos que hay fases de crecimiento de mayor duración y periodos de corrección de corta duración. Una excepción es el periodo entre octubre y diciembre de 2018, en el que el DAX perdió valor de forma constante. No parece ser predecible cuándo y qué fase reemplazará a la anterior,

El límite de pérdidas se establecerá en 300 puntos (precio de apertura/40) cuando se negocie con CFDs, el precio objetivo será de 120 puntos (precio de apertura/100).

ya que a menudo, se inspira en las noticias económicas, políticas o tasas de interés. Por el contrario, sin embargo, los ciclos recurrentes dentro de un año natural también juegan un papel importante. A primera vista, es poco probable en este caso encontrar una manera de posicionar una operación a corto. Sin embargo, a diferencia de las materias primas, o las divisas, un trader activo en el DAX nos ayudará en cierta medida: en el cronometraje temporal. Nos indicará el ritmo del día y de la semana, reflejando los patrones recurrentes de comportamiento de los accionistas. En estos períodos vale la pena echar un vistazo aún más de cerca a esta variable. Un patrón recurrente de comportamiento de los accionistas podría ser la compra acciones a partir del martes y su continuación hasta el viernes. El viernes por la noche, la indicación del DAX de postventa (X-DAX) a menudo alcanza un punto máximo temporal. A partir del lunes por la mañana, se les da de nuevo a los accionistas indecisos la oportunidad de desprenderse de sus acciones, ya sea a través de una tentativa de venta o a través de los límites de pérdida. Este movimiento se puede operar maravillosamente a corto sin tomar mayores riesgos, que de otro modo estarían siempre presentes en el DAX. El sistema de trading lo desarrolló el autor del artículo a finales de 2016 y ha estado funcionando con dinero real desde entonces. Por supuesto, no se ofrece ninguna garantía de que continuará haciéndolo en el futuro. En cierto sentido, un trader activo con sus sistemas de trading es comparable a un DJ con sus discos: ningún disco será el mejor siempre. Aunque sea responsabilidad del DJ reproducir siempre sus discos, lo cual nos dará el placer de escucharlos en el entorno actual.

La regla de entrada

Los viernes a las 21:00, se abrirá una posición corta en el DAX con la ayuda de un CFD y siempre que el índice haya ganado al menos 240 puntos desde las 9:00 a.m. del lunes hasta las 9:00 p.m., pero no más de 425 puntos. Para facilitar la comprensión, os proporcionamos números específicos, con un precio del DAX de 12,000 puntos. Para la ejecución automatizada con pruebas de retorno en sentido ascendente, es mejor usar las siguientes variables: Precio de apertura dividido por 50 (en lugar de 240 puntos) y precio de apertura dividido por 28 (en lugar de 425 puntos).

Gestión de la posición y salida.

El riesgo por operación será del 10 % del capital de trading disponible y permanecerá sin cambios durante la operación. El límite de pérdidas se establecerá en 300 puntos (precio de apertura/40) cuando se negocie con CFDs, el precio objetivo será de 120 puntos (precio de apertura/100). Si se usan productos de apalancamiento, se seleccionará de manera tal que el precio de ejercicio sea aproximadamente igual al límite de pérdidas planificado. En consecuencia, a medida que se compran muchos

G1 Operación con un beneficio óptimo en junio de 2018

El viernes 15 de junio de 2018, el sistema abrío una operación a corto a las 21:00. Según las reglas, el índice había aumentado en más de 240 puntos desde el lunes a las 9:00 am, pero menos de 425 puntos. El precio de entrada de la posición estuvo alrededor de los 13.060 puntos. Al lunes siguiente se alcanzó el precio objetivo en los 12,940 puntos rápidamente.

Fuente: www.tradesignalonline.com

G2 Beneficio difícil en noviembre de 2018

El viernes 2 de noviembre de 2018, el sistema entró en una operación corta a las 21:00. Según las reglas, el índice había aumentado en más de 240 puntos desde el lunes a las 9:00 am, pero menos de 425 puntos. El precio de entrada de la posición estuvo alrededor de los 11.550 puntos. La operación se realizó al lunes siguiente y ese mismo martes ya se alzó en positivo y casi alcanzó el objetivo de ganancias antes de que el precio se revirtiera y la posición se metiese en pérdidas. Luego el mercado volvió a girar y alcanzó el precio objetivo de 11,430 puntos.

Fuente: www.tradesignalonline.com

CFDs o productos apalancados, se cumple con el riesgo estimado del 10 %. Con un tamaño de cuenta de 10,000 euros, es decir exactamente 300 euros con un riesgo de trading de 300 puntos, y por lo tanto, si usamos 3 CFDs tendríamos un riesgo total de 900 euros. Si la operación no se completa después de 15 días, la posición se cierra. En muchos casos, el precio objetivo ya se alcanza al lunes siguiente. Pero también puede durar hasta el martes o el miércoles. El sistema de negociación se basa en una alta tasa de aciertos, lo que coloca en un segundo plano la relación de riesgo/oportunidad (CRV) relativamente pobre para la posición individual.

Retrospectiva

En opinión del autor, los 3 últimos años han sido de particular importancia para poder obtener la información precisa sobre un sistema de trading que opera en el DAX. Cuanto más se usen los datos del pasado, más relevancia pierden. Por ello, sólo se considerarán los datos históricos para duraciones mayores de 5 años si hay una razón específica para hacerlo.

Robustez

El sistema de trading es simple, funciona sin filtros y sigue al latido del DAX. Por ello tiene una robustez natural. Un cambio en la curva de rendimiento no debe notarse durante el período que salga fuera de la muestra tras la prueba. Durante la revisión de la robustez no se utilizaron análisis adicionales o simulaciones de Monte Carlo, ya que, en opinión del autor sobre el DAX, solo tienen una importancia baja.

Conclusión

La estrategia del DAX que se ha presentado en este artículo es fácil de implementar y hasta ahora ha demostrado ser extremadamente estable. El beneficio se puede aumentar con una posición más grande. Es posible poner un límite de pérdidas más cercano para alcanzar un riesgo menor de aproximadamente la mitad, 150 puntos, pero obligaría al trader a volver a reentrar cuando salga de la posición.

Instantánea de Estrategia

Nombre de la estrategia:	DAX a corto
Tipo de estrategia:	Anticíclica
Horizonte temporal:	Gráfico de 1 hora
Configuración:	El DAX debe estar ganando al menos 240 (o precio de apertura/240 puntos) de 9:00 AM a 9:00 PM del lunes, pero menos de 425 (o precio de apertura /28 puntos)
Entrada	El viernes a las 21:00
Límite de pérdidas:	300 puntos o Apertura + (precio de apertura /40)
Objetivo de beneficios:	120 puntos o Apertura - (precio de apertura /100)
Salida:	Al alcanzar el precio objetivo o después de 15 días
Gestión de riesgos por operación:	10% de riesgo por operación
Promedio de señales:	Más del 90% desde fines de 2016
Promedio de aciertos:	Más del 90% desde fines de 2016
Rendimiento promedio:	28% anual con 10 % de riesgo por operación
Pérdida máxima:	Del 7% al 10% de riesgo por operación