



CÓMO MEJORAR UNA ESTRATEGIA DE ÉXITO.

Trading intradía usando el futuro del DAX

La estrategia que presentamos a continuación es una versión extendida del enfoque presentado con anterioridad en nuestra revista TRADERS'. La estrategia de negociación a corto plazo se basa esencialmente en la reversión a la media, aunque también se puedan operar los días tendenciales.

En el artículo anterior dijimos que los precios del futuro del DAX pasaban por encima del precio de cierre del día anterior en alrededor del 90 % de todos los días de negociación, pero solo cierran en esos niveles en el 55 % de

los casos. Por el contrario, el precio baja por debajo del precio de cierre del día anterior en alrededor del 90 % de todos los días de negociación, pero cierra por debajo de él en menos de la mitad de los casos. Basándose en ello, el autor diseñó su estrategia de trading intradía.



Georg Mindermann

Georg Mindermann operó como trader de metales durante muchos años y más tarde se convirtió en el director gerente de una empresa de gestión de capitales. Hoy vive y opera desde España. Las reglas que describimos a continuación pero de forma detallada de su estrategia se pueden solicitar de forma gratuita al autor:

✉ g.mindermann@gmx.de

Los horarios de trading

El día de negociación comienza a las 8:00 a.m. y dura hasta las 10:00 p.m. Con esta estrategia, las horas de negociación se dividen en horario de mañana (8:00 a.m. a 2:30 p.m.) y de tarde (2:45 p.m. a 10:00 p.m.) porque los enfoques de trading son diferentes en estos 2 marcos temporales. En consecuencia, los traders que operan a tiempo parcial en tan sólo uno de los 2 marcos, también pueden beneficiarse de esta estrategia. Comencemos con la descripción de la operativa para el marco temporal de mañana.

El cierre de una posición con pérdida se dará cuando una posición aún abierta se mueva a la zona de pérdidas previamente definida.

Zonas de acción

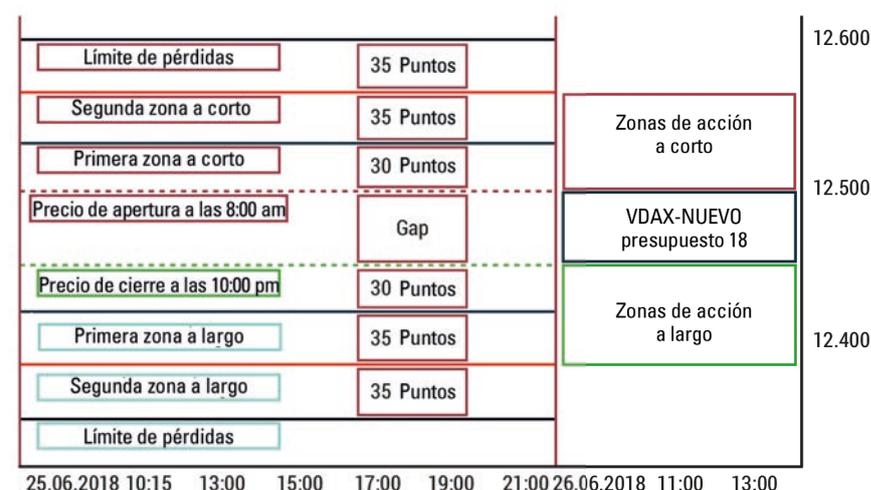
A diario se crea un marco de trading con zonas de acción dependientes de la volatilidad, que forman la base de la estrategia. Las zonas se dibujan en base a los muchos años de experiencia del autor, las cuales nos mostrarán dónde se dan, dentro del rango de negociación, la mayoría de las correcciones (retrocesos) que suele ser hacia el precio medio e incluso más allá. En consecuencia, las zonas se utilizan para identificar puntos favorables en el que abrir posiciones a largo o a corto. Después de la primera cotización de precios del FDAX a las 08:00, hay 4 momentos clave que son relevantes para la definición de las zonas de acción:

- Precio de cierre del Xetra-Dax a las 5:30 pm del día anterior.
- Precio de cierre del FDAX a las 10:00 pm del día anterior
- Precio de apertura del FDAX como precio de referencia para el día de negociación actual.

La Figura 1 muestra esquemáticamente cómo se ve la división de zona. Dependiendo de la volatilidad, el rango de negociación diario se ampliará o reducirá. La zonificación se ajusta de manera flexible de acuerdo al estado del VDAX NUEVO:

- VDAX NUEVO por debajo de 20 = 3 puntos para los primeros 35 y 35 para la segunda zona
- VDAX NUEVO entre 20 y 25 puntos = 45 puntos cada uno
- VDAX NUEVO entre 25 y 30 puntos = 50 puntos cada uno
- VDAX NUEVO entre 30 y 35 puntos = 60 puntos cada uno
- VDAX NUEVO por encima de 35 = 60 puntos cada uno, pero sin entrar en la primera zona a largo.

G1 Marco de trading con zonas de acción



Fuente: Georg Mindermann

Posiciones vacantes

Se abre una posición cuando el precio alcanza la primera línea de la zona (a corto o a largo). Si la primera posición tiene pérdidas en la segunda zona, la posición se duplica una vez. Destacamos aquí que la reducción en el precio en la segunda zona contribuye significativamente al éxito de la estrategia. La relación de ganancias/pérdidas es de 2:1.

Toma de ganancias

La ganancia se toma si la posición de la primera zona alcanza el precio de apertura o cierre del día anterior. Del mismo modo, el cierre se lleva a cabo con una ganancia si una posición de la segunda zona alcanza nuevamente la línea de la primera zona.

Gestión de riesgos y dinero

Al mismo tiempo, por supuesto, la estrategia también limita las posibles pérdidas. El cierre de una posición con pérdida se dará cuando una posición aún abierta se mueva a la zona de pérdidas previamente definida. La cual se

Las pérdidas no solo ocurren durante los días de tendencia.

encuentra a 35 puntos por encima o por debajo de la segunda zona. Si las posiciones siguen abiertas a las 22:00, se cierran al final del día con ganancias o pérdidas. La estrategia también funciona con límites de pérdida temporales. Si las posiciones se abren por la mañana y todavía están en pérdidas poco antes de las 2:30 p.m., se activa el límite de pérdidas temporal y se cierran las posiciones. En la administración del dinero, se utiliza la operativa de proporción fija según Ryan Jones. Lo cual significa que se aumenta la posición en las fases de ganancias y se disminuye la posición en las fases de pérdidas.

Nuevas aperturas de posiciones con protección de ganancias

Si se obtuvieron ganancias de la primera o segunda zona, o ambas, se pueden abrir más operaciones nuevas durante el mismo día de negociación. Sin embargo, las operaciones en un activo solo se abrirán en la segunda zona si las posiciones de las zonas de acción primera y segunda ya se han cerrado con éxito en el lado inferior o superior del gráfico.

Huecos

Los huecos son movimientos que saltan un cierto rango de precios en el que no se realiza ninguna operación. Los huecos normales ya no se considerarán, a menos que sea un hueco doble o super amplio. Tal es el caso si, por ejemplo, el FDAX cotiza a las 10 p.m. 20 puntos por encima o por debajo del precio de cierre del Xetra DAX y abre al día siguiente con otro hueco en la misma dirección (por ejemplo, 50 puntos adicionales). En general, el hueco debe ser de al menos

G2 Doble hueco



El gráfico muestra que el precio de apertura está más de 70 puntos por debajo de los precios de cierre del Xetra DAX y del FDAX. En la apertura a las 08:00 se abre una posición a largo con el objetivo de obtener ganancias en base al precio de cierre del FDAX del día anterior. Una vez que se ha cerrado esta posición, se llevará a cabo el trading de zona normal.

Fuente: Georg Mindermann

G3 Tendencia día largo



El 11 de octubre de 2019, siguiendo el conjunto de reglas, se pudo abrir una operación de seguimiento tendencial durante la mañana después de la apertura. La mitad de la posición se cerró a las 2:30 p.m. y la otra mitad a las 5:30 p.m. al final del Xetra DAX (ver líneas verdes).

Fuente: Georg Mindermann

Un enfoque de trading sistemático con elementos discretos requiere una presencia cercana a la pantalla.

70 puntos. En este caso, se abre una posición inversa directamente en la apertura de las 8:00 a.m. Sin embargo, si se produce un hueco monstruoso de más de 200 puntos, entonces no se realiza ninguna operación ese día.

Apertura de posiciones dependientes de las noticias

Antes de las publicaciones importantes, como los datos del mercado laboral de los EE.UU. (el primer viernes de cada mes a las 2:30 p.m.) así como de las decisiones sobre los tipos de interés de la FED o el BCE se abrirán posiciones a largo cuando lo confirme una vela de 5 minutos, siempre y cuando el futuro del Dow Jones no tenga pérdidas.

Seguimiento tendencial intradía

Además, se entrará si el futuro del Dow Jones durante los días normales de negociación a las 8:00 am tiene al menos un 0.5 % de ganancia (o pérdidas) y las bolsas de valores en China y Japón también han cerrado con al menos 0.5 % positivo (o menos). Esta entrada busca un seguimiento tendencial a largo o a corto según se haya producido un catalizador de la noche a la mañana en forma de noticias muy positivas o negativas.

Trading de tarde

Regresamos a la segunda ventana de la configuración inicial. Muchos días de negociación aún por la tarde no han agotado su rango de negociación antes de las 2:30 pm cuando comienza la operativa previa del mercado de EE. UU. En este punto, primero dibujaremos el rango de negociación hasta las 2:30 pm como posible zona de valor. Un rango de negociación intradía de tarde de mayor a menor de al menos 100 puntos es un requisito previo para operar durante la tarde (excepto para la configuración 3). En base a esta zona, se tomarán las medidas necesarias para abrir una posición si estamos ante una de las 4 formaciones siguientes:

1. Extensión del rango (posible a largo y corto)
2. Negociación al precio medio, cuando el precio se negocia en la línea del límite de pérdidas definido durante la mañana (posible a largo y corto)
3. El precio cruza la línea de precio de cierre desde la parte inferior de la presentación (solo a largo)
4. Trading en la dirección del precio de apertura (posible a largo y a corto)

Un posterior análisis del trading de tarde durante el 2019 mostró que se ejecutaron un total de 116 órdenes. Se obtuvieron ganancias durante 105 días, una pérdida durante 5 días y el punto de equilibrio durante 6 días.

Ajustes para reducir las pérdidas

Por supuesto, surge la pregunta de cuándo y dónde se darán las pérdidas y cómo se pueden prevenir o reducir. Las pérdidas no solo ocurren durante los días de tendencia. Algo significativo de las operaciones con pérdidas es que una, o ambas, de las zonas de alto volumen se atraviese con una negociación rápida y clara. A pesar de todos los cuidados, las pérdidas no pueden evitarse por completo, sino tan sólo reducirse adaptando las zonas de acción. Si se abre una posición en la primera zona y luego descubrimos que ha cambiado y no hay corrección visible entre la primera y la segunda zona, solo se realizará una nueva entrada después de una vela de inversión. Si se cierra

Instantánea de Estrategia

Nombre de la estrategia:	Estrategia de zona de acción
Tipo de estrategia:	Reversión a la media
Horizonte temporal:	Intradía
Configuración:	Se deben alcanzar las zonas de acción dependientes de la volatilidad, posible hueco < 200 puntos.
Entrada:	a largo o a corto en la primera y segunda zona de acción.
Límite de pérdidas:	35 puntos después de la segunda zona de acción.
Toma de beneficios:	El precio de cierre del día anterior para la primera posición, primera zona de acción para la segunda posición.
Límite de pérdidas final:	Ninguno.
Límite de pérdidas horario:	2:30 pm si la posición se pierde, cerrar las posiciones restantes a las 10:00 pm
Gestión de riesgos y del dinero:	Duplicación planificada de posiciones en la segunda zona de acción.
Ganancia /Pérdida promedio:	0.93
Número de días ganadores:	73%

más de 10 puntos por debajo de la segunda zona, solo se abrirá la mitad de la posición y se redefinirá el límite de pérdidas.

Tecnología de negociación y ejecución de órdenes

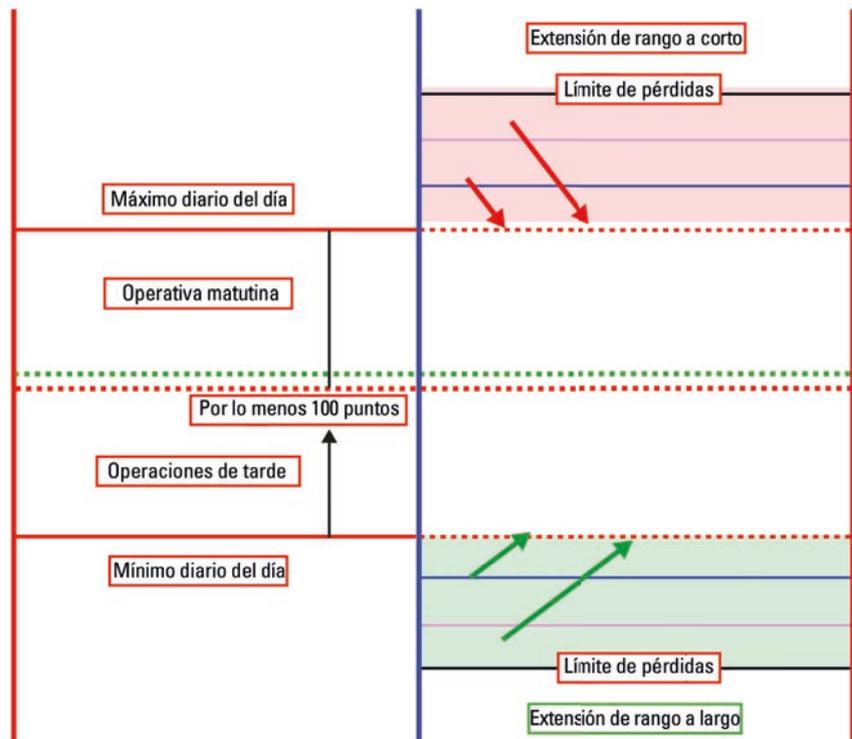
Un enfoque de trading sistemático con elementos discretos requiere una presencia cercana a la pantalla. Por ejemplo, después de que se haya creado el marco de negociación, se debe establecer una alarma entre 10 y 15 puntos sobre las zonas. Las órdenes limitadas con objetivo de ganancias y límite de pérdidas también deben realizarse con anticipación. A veces los precios cruzan las zonas dinámicamente; a veces hay un toque preciso con inversión inmediata. También hay una ligera falta de las marcas en 1 o 2 puntos. Un trader capacitado podrá, por ejemplo, retener una orden limitada hasta después de que salte la alarma para obtener así un reinicio inmediato sin tener que ejecutar la orden de antemano. Lo cual también se aplica a la toma de ganancias.

Conclusión

La estrategia presentada tiene un alto potencial de ingresos y es muy fácil de implementar sin requerir un ritmo demasiado fuerte siempre y cuando el conocimiento de las reglas se haya entendido bien y tras un período de formación adecuado por parte de los traders más apasionados y experimentados. Como la susodicha contiene elementos discretos, deberá estar cerca de la plataforma de trading.

Georg Mindermann documenta sus operaciones diariamente en su sitio web www.candletalk.de.

G4 Extensión de rango



El gráfico describe la idea de expandir el rango al trading de tarde con los límites de pérdidas y los objetivos de ganancias correspondientes (ver flechas).

Fuente: Georg Mindermann

G5 Sin pérdida gracias al ajuste de zona



El 19 de marzo de 2018, las posiciones largas se cerraron con una gran pérdida (líneas verdes a la izquierda). En la extensión de rango (RE) después de las 2:30 pm, la pérdida se redujo (líneas verdes a la derecha). Un ajuste de zona no habría obtenido pérdidas, sino ganancias.

Fuente: Georg Mindermann