



Operando con Oro

Optimizando resultados a nivel usuario

“Recopilar datos y analizarlos es una actividad que parece aislada del mundo del trading. Digo esto porque la gran mayoría de Traders se limitan a entrar y salir de los mercados sin prestar atención a esa gran información que existe detrás de bambalinas. Solo unos pocos se dedican a pulir y sacar brillo de algo que resulta muy agobiante y frustrante para el resto. El premio: Una evidente y clara ventaja competitiva”

» El inicio de todo trader

En mis comienzos como trader, recuerdo que disparaba a todo lo que se movía. Lo mismo operaba EUR/USD que operaba DAX o Plomo, SP500 o Petróleo y un larguísimo etc...

Esto no tendría nada de malo, si no fuese porque operaba con un desconocimiento total y absoluto de aquello en lo que me metía. Operaba sin ningún criterio. Sin niveles y sin estudios previos.

¿Qué sabía yo en aquel entonces, sobre el comportamiento del Eur/Usd? ¿Acaso conocía los fundamentales que inciden en el precio del Plomo? No conocía siquiera, que existían los inventarios de Petróleo. Por lo tanto había algo que sí me salía bien. PERDER.

Esto sí que lo hacía bien. Era totalmente regular en mis pérdidas. No había día ni semana ni mes, que no perdiese parte o casi la totalidad de mi capital. Claramente había algo que me impedía obtener resultados positivos y sostenidos en el tiempo. Esto sucede al principio, pero sobre todo cuando alguien se convierte en autodidacta. Hace 13 años no existía la cantidad de información que circula hoy en día. Y la poca que había no tenía ni la más remota idea de cómo ordenarla. Me faltaba mucho y me sobraba todo. Cualquier paso se convertía automáticamente en una derrota. Con el tiempo aprendí muchas cosas. Gestión del riesgo, tamaño de la posición, niveles relevantes para la operativa diaria, uso de indicadores técnicos y su programación, gestión de carteras, análisis

fundamental, etc.. Pero una de las cosas que más rentabilidad ha aportado a mi operativa ha sido el tratamiento de datos históricos.

Analizando un poco donde me encontraba y a donde quería llegar, me di cuenta de que si quería llegar a alcanzar una consistencia en el trading, tenía que coger el toro por los cuernos. Debía estudiar bien a mi enemigo. Como, donde y cuando se mueve. En qué proporción lo hace en cada hora del día, cuales son los fundamentales que inciden directamente en la fluctuación del precio, etc..

Para ello estaba claro que debía recoger una serie de datos, analizarlos y procesarlos.

Recopilando información

De esto va el presente artículo. A continuación os voy a mostrar cómo podemos optimizar nuestro tiempo y a la vez nuestro dinero, teniendo en cuenta una serie sencilla de datos. En este caso, me voy a centrar en el Oro aunque este estudio es extrapolable a cualquier activo. Únicamente deberemos recoger una serie de datos (y esta va a resultar la tarea más tediosa, ya que los tendremos que recopilar de varios años y cuantos más mejor) y trasladarlos a una hoja de cálculo (Excel). No os preocupéis porque es muy sencillo. De momento no os voy a hablar de fórmulas (ni sencillas ni complejas) ni algoritmos matemáticos ni nada por el estilo. Primero de todo tendremos que identificar las diferentes sesiones en las que se mueve el precio, es decir, sesión Europea, sesión Americana y sesión Asiática. Para ello es conveniente utilizar algún indicador que nos permita colorear estas zonas para identificarlas sin problema. Ver imagen inferior

De este modo, podremos identificar sin problemas cuando termina y cuando comienza una sesión determinada, además de sus solapes (Cuando empieza una sesión y la anterior está todavía en marcha, se solapan las sesiones aumentando la liquidez puesto que se unen, por un lado el capital de una sesión y por otro, el de la sesión entrante)

Podéis encontrar varios indicadores de este tipo en el mercado de forma gratuita. Yo personalmente uso uno que se llama “i-sesions” para Metatrader que además ya me muestra los niveles de precios mínimo y máximo de cada sesión.

El estudio

Solamente vamos a recoger los siguientes datos:

- Fecha: Día-Mes-Año
- Máximo alcanzado de cada sesión
- Mínimo alcanzado en cada sesión

El formato de la tabla en la recogeremos los datos será el siguiente:

En el apartado “Sesión” colocaremos el nombre de cada una de las sesiones para las que vayamos recopilando los datos. En el apartado “Días” colocaremos la fecha del día de la recogida de datos. En las ventanas de Máximo y mínimo anotaremos los datos correspondientes a la sesión determinada. En el apartado “Ruptura” como podéis comprobar utilizo tres colores diferentes. Estos colores los aplico de la siguiente forma: Si en la siguiente sesión se rompe el máximo de la sesión actual lo pinto de “Verde” y si por el contrario se rompe por debajo (es decir, el mínimo de la sesión actual) lo pinto de “Rojo”. Si en la siguiente sesión no se rompe ni el mínimo ni el máximo, lo pinto de “Morado”.

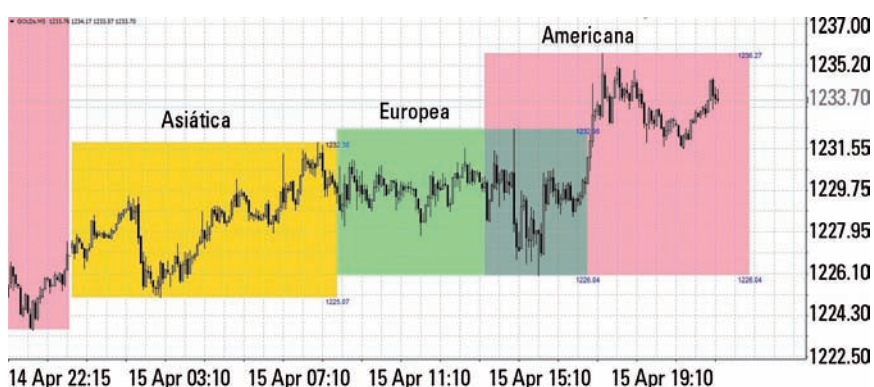
Posteriormente mido la ruptura en puntos y los anoto en la columna “Puntos”. Apunto también en el apartado “Roto” la sesión o solape en los que se produce dicha ruptura para identificar cuál ha sido la sesión más rentable.

La conclusión

Con esta tarea, consigo varias cosas:

- Tengo identificada, cuál es la sesión que más puntos mueve. Es ahí donde quiero estar porque tengo

G1) Identificando las distintas sesiones



Es importante identificar en qué sesiones se producen los grandes movimientos para aprovechar al máximo nuestros recursos, incluido el tiempo.

Fuente: Trading12

G2) Tratamiento de los datos

	A	B	C	D	E	F	G
1	FRECUENCIA Y CUANTIA DE ROMPIMIENTOS EN SESIONES						
2							
3							
4	Sesión	días	maximo	minimo	ruptura	puntos	roto
5			ENERO				
6	ASIATICA	02/01/2015	1.188,15	1.184,06		1676	Europea
7						665	Solape E+A
8		05/01/2015	1197,73	1177,94		460	Europea
9		06/01/2015	1212,3	1201,51		181	Europea
10		07/01/2015	1218,49	1211,76		310	Europea
11		08/01/2015	1214,05	1204,63		40	Europea
12						221	Solape E+A
13		09/01/2015	1214,07	1207,17		50	Solape E+A
14						655	Solape E+A
15		12/01/2015	1230,99	1217,36			
16		13/01/2015	1243,99	1230,42			
17		14/01/2015	1234,29	1224,85		976	Solape E+A
18		15/01/2015	1232,09	1225,76		3164	Europea
19		16/01/2015	1263,75	1254,81		1463	Solape E+A
20		19/01/2015	1281,31	1274,28		234	Solape E+A
21		20/01/2015	1292,57	1273,7		132	Europea
22		21/01/2015	1303,31	1290,33		197	Solape E+A
23						611	Solape E+A
24		22/01/2015	1293,53	1283,16		380	Europea

Si recogemos y estudiamos los datos de los máximos, mínimos, rupturas de sesiones y puntos de recorrido, pondremos más probabilidades a nuestro favor.

Fuente: Trading12

mayor probabilidad de éxito. Así pues, supongamos (Y digo supongamos porque reservo el resultado del estudio para nuestros clientes de los servicios de trading en Vivo) que la sesión Europea (de 9:00h a 17:50) es la que mueve muchos más puntos y la sesión Americana la que menos mueve. ¿Qué pinto yo entonces, sentado a operar Oro en la sesión Americana, si tengo muchas más probabilidades de hacer negocio en la Europea?

- Por otro lado identifico en que sesiones se han producido más rupturas de los máximos y mínimos mar-

se ha movido menos puntos, dedico ese mes a otro activo que me proporcione más oportunidades de negocio.

Aunque recopilemos datos históricos, NO tenemos una garantía al 100% de que el subyacente se vaya a comportar de igual modo, que el que nos arroja el estudio pero desde luego que tendremos una buena base para comenzar a optimizar nuestra operativa. Si por ejemplo el Oro se mueve los Lunes históricamente 4.000 puntos más que cualquier otro día, obviamente estaré operando todos los lunes aunque esto no signifique, que cuando lo haga se vaya a cumplir. Si por ejemplo los resultados de la sesión Asiática se suelen romper al alza de media un 83% en el solape de las sesiones Europea y Americana, pondré mucho más volumen en mis compras en esa franja horaria que en otra diferente.

Espero haberos ayudado con mi planteamiento y aunque reconozco que es una tarea muy aburrida y pesada (A mí personalmente me ha llevado dos años recopilar toda la información del estudio del Oro) os ayudará a optimizar vuestros recursos a la hora de hacer Trading. «



Jose Martínez

Jose Martínez es el fundador y CEO de www.trading12.com. Es trader a tiempo completo desde hace más de 12 años y desde entonces opera todos los días en directo para sus clientes. Máster en gestión financiera y Bolsa, diplomado en gestión de carteras y day trading, especializado en los mercados financieros de las Materias Primas y formador de Traders.

✉ info@trading12.com