

MANUAL GRATUITO

COMO GANAR +44% EN 6 MESES con trading forex

4 aspectos determinantes para batir al mercado

operando los principales cruces de FOREX
flujos de divisas y estructuras del precio



Contenido

INTRODUCCIÓN.....	3
PON LA ESTADÍSTICA DE TU PARTE	5
BUSCANDO LA POSICIÓN DOMINANTE	8
GESTIÓN DE LA POSICIÓN	10
GESTIÓN EMOCIONAL	12
CONCLUSIONES	13

INTRODUCCIÓN

La verdad es que llegar a conseguir la rentabilidad del **+44% en los 6 primeros meses de este año** lleva detrás miles de horas de práctica durante años, de trabajo, de dudas, de alegrías, noches de insomnio, perder alguna que otra cuenta y mucho dinero invertido.



Finalmente, todo lo vivido, se convierte en gratificación cuando **desarrollas una metodología**, un proceso de operativa, un estado de ánimo que te permiten afrontar el mercado desde otra perspectiva que antes no eras capaz de dominar, y como no, lograr que tu cuenta de trading aumente.

No tiene nada que ver con entrar en el mercado en un punto exacto porque te lo indique uno o un conjunto osciladores, o buscando giros sin pautas de confirmación. Ni tampoco con ir probando sistemas y sistemas cuando uno tras otro fallan.

Más bien todo ello es el resultado de una visión global del mercado, una actitud, intentar dominar ciertas emociones, identificar los movimientos del mercado y buscar siempre los ratios adecuados.

A lo largo del contenido de este manual vamos a mostrar los principales aspectos a tener en cuenta según el enfoque de nuestra metodología desde nuestro propio punto de vista.

Desde el mes de febrero el máximo drawdown apenas ha superado el 7% del capital inicial, lo que supone una racha de 3,5 operaciones negativas seguidas.

Es muy importante determinar el riesgo por operación y la racha de pérdidas, antes que imaginar cuál va a ser nuestro rendimiento. Lo fundamental es preservar el capital e intentar rentabilizar la cuenta de trading a través de una metodología. **Será el dominio que tengamos de esta metodología y del dominio de nosotros mismos** lo que nos permitirá ser más eficientes en la operativa.

Después de cumplirse un año de la revisión de la operativa, con el tiempo vas ganando eficiencia y adquiriendo experiencia que te permite ir avanzando en este apasionante mundo del trading, pero que a la vez se convierte en una lucha contra uno mismo y contra el resto de los operadores del mercado.



En la imagen vemos la curva de balance por operación cerrada y la curva de drawdown. Vemos con el paso del tiempo como la operativa se vuelve más eficiente, sin entrar en pérdidas superiores al 10%, ni entrar en un periodo prolongado de pérdidas.

Aunque existan periodos de pérdidas, que los hay y los habrá (es una característica inherente del trading), lo importante es que la curva sea lo más estable posible en el tiempo y minimizar o corregir los movimientos que no evolucionan a nuestro favor. Creemos que lo hemos conseguido.

PON LA ESTADÍSTICA DE TU PARTE

El mundo del trading cada vez es más accesible al trader o especulador retail, simplemente es necesario disponer de un PC o portátil con una conexión a internet y a un bróker que proporcione una plataforma de acceso al mercado.

Evidentemente es necesario disponer de conocimientos del mercado en cuestión y una estrategia donde la esperanza matemática (E) cumpla la condición **$E > 0$** .

$$E = (Prob Win) \times (Avrg Win) - (prob Loss) \times (Prob Loss) - Fees$$

E = esperanza matemática

Prob Win = porcentaje de aciertos

Avrg Win = media de ganancias

Prob Loss = porcentaje de operaciones negativas

Prob Loss = media de pérdidas

Fees = comisiones aplicadas por la operativa

Añadimos las comisiones porque en determinados productos, mercados o brókers, pueden incidir de forma muy negativa en el rendimiento final de la operativa.

Por lo tanto debemos actuar en incrementar en todo lo posible la esperanza matemática E para rentabilizar nuestra operativa.

Para que nuestra estrategia sea ganadora es fundamental que $E > 0$

Descartando la variable de las comisiones, puesto que la búsqueda de un bróker que ofrezca condiciones competitivas, será una labor de análisis de las distintas posibilidades del mercado, **debemos actuar sobre el porcentaje de aciertos y el ratio media de ganancias / media de pérdidas.**

En la siguiente tabla mostramos la relación existente entre estas variables.

Relación beneficio-riesgo \ Porcentaje de aciertos	3	2,5	2	1,5	1	0,75	0,50	0,25
80%	2,20	1,80	1,40	1,00	0,60	0,40	0,20	0
75%	2,00	1,63	1,25	0,88	0,50	0,31	0,13	-0,25
70%	1,80	1,45	1,10	0,75	0,40	0,23	0,05	-0,50
65%	1,60	1,28	0,95	0,63	0,30	0,14	-0,03	-0,75
60%	1,40	1,10	0,80	0,50	0,20	0,05	-0,10	-1,00
55%	1,20	0,93	0,65	0,38	0,10	-0,04	-0,18	-1,25

50%	1,00	0,75	0,50	0,25	0,00	-0,13	-0,25	-1,50
45%	0,80	0,58	0,35	0,13	-0,10	-0,21	-0,33	-1,75
40%	0,60	0,40	0,20	0,00	-0,20	-0,30	-0,40	-2,00
35%	0,40	0,23	0,05	-0,13	-0,30	-0,39	-0,48	-2,25
30%	0,20	0,05	-0,10	-0,25	-0,40	-0,48	-0,55	-2,50

Podemos observar que no necesariamente tener un porcentaje de aciertos elevados asegura tener un sistema ganador.

Durante todos estos años, hemos podido analizar muchos sistemas y operativas distintas tanto en el trading automático con robots como con metodologías discrecionales.

Una de las muchas conclusiones que hemos extraído es que a largo plazo es muy difícil ganar con sistemas que tienen un alto porcentaje de aciertos pero con un bajo ratio, incluso en momentos de mercado con muy baja volatilidad.

Como vemos en la tabla, una estrategia que acierta un 70% de las veces (porcentaje excelente) pero necesita ganar 4 veces para recuperar lo que pierde en 1 operación (ratio = 0,25), es un sistema perdedor.

Es muy difícil que estas estrategias a medio y largo plazo sean rentables aunque lo puedan ser en el corto plazo.

Por lo tanto nuestro objetivo ideal será buscar un alto porcentaje de aciertos y un valor alto del ratio (media de ganancias / media de pérdidas).

También podemos observar que un sistema o estrategia que tiene un porcentaje de aciertos del 40% puede ser ganadora si tiene un ratio = 2, es decir que lo que pierde en dos operaciones lo recupera en 1 operación ganadora.

Lo más importante es buscar aumentar el ratio media de ganancias / media de pérdidas

BUSCANDO LA POSICIÓN DOMINANTE

Cuando analizamos un gráfico, lo primero que debemos hacer es marcar las principales líneas de tendencia de soportes y resistencias. Definimos la cotización de los precios por zonas y no por precios exactos. Es decir, el rango de precios no los que podemos considerar una resistencia, soporte o tendencia puede variar en torno a 20-30 pips en time frame de H4.

Los soportes y resistencias son niveles psicológicos y son susceptibles de ser respetados por los operadores

Después de tener claros los soportes, resistencias y tendencias, debemos identificar algunas estructuras relevantes que nos den pistas o indicios de la posible o futura dirección del precio.

Existen 3 estructuras básicas que podemos operar si nos fijamos exclusivamente en el gráfico.

- Continuación de tendencia en retrocesos.
- Estructuras de vuelta como hombro-cabeza-hombro (H-C-H), doble techo (DT) o doble suelo (DS).
- Rangos consolidados.

Nunca nos posicionamos en contra de la tendencia del precio sin antes encontrar una figura que lo justifique como las estructuras de vuelta. Un símil bastante acertado a esta acción sería como ponerse delante de un tren a toda máquina.

Para identificar la direccionalidad de las principales divisas, utilizamos el forex index (FI) o currency index como herramienta fundamental. El FI es el sumatorio de la cotización de una divisa con respecto a las demás, por lo que el FI del EUR o euro index es el ratio ponderado de las principales divisas contra el euro. Esta representación aritmética nos da una relación de la fortaleza o debilidad de cada divisa.

Normalmente los flujos de divisas o las entradas y salidas, se suelen ver reflejados en el FI. Estas entradas y salidas de flujos se producen por hechos fundamentales y no suelen ser circunstanciales, sino que son flujos que pueden durar varios días e incluso semanas o meses.

Estos flujos de divisas claros y evidentes son los que debemos aprovechar.

Evidentemente existen muchos momentos o timing de mercado donde los flujos no son claros. En estas circunstancias debemos esperar a

que se produzca una direccionalidad clara en la entrada/salida de flujos.

Si no se producen situaciones claras no debemos padecer la necesidad de estar dentro del mercado o forzar una operación. Es el riesgo de sobreoperar cuando no se ven situaciones potenciales de rendimiento o después de pérdidas, el que nos puede provocar pérdidas excesivas y sin control.

Debemos identificar la entrada / salida de flujos junto con estructuras relevantes

GESTIÓN DE LA POSICIÓN

Una vez dentro del mercado ya no debemos sufrir por la evolución de la posición, ya que previamente hemos introducido sus correspondientes stop de pérdidas y objetivo de beneficio.

En el momento que hemos decidido ejecutar una operación o identificado el cruce o par con potencial recorrido a favor, tenemos 4 variables a definir:

- Máximo riesgo por operación
- El tamaño de la posición
- Dónde colocar el stop
- Donde colocar el objetivo de beneficio

El tamaño de la posición siempre será variable y no podemos calcularlo sin antes determinar donde debemos colocar el stop.

Nosotros recomendamos en la mayoría de las ocasiones (existen excepciones) colocar el stop por debajo de algún soporte relevante y más o menos próximo en las posiciones de compra, y por encima de resistencias relevantes en las posiciones de venta.

Recordemos el efecto psicológico que tienen estas zonas para los operadores actuando en muchas ocasiones como zonas de soporte.

En función de la distancia al stop y aplicando la fórmula:

$$T_p = \frac{C_t \times P_a}{D_p \times V_p}$$

T_p = Tamaño de la posición

C_t = Capital de trading

P_a = Porcentaje arriesgado

D_p = Distancia del stop

V_p = Valor del pip

La distancia al objetivo siempre será mayor que la distancia al stop. Por término general entre 1,5 y 2 veces. Esto nos permitirá que aún teniendo un porcentaje de aciertos por debajo del 50% tengamos un sistema ganador.

En función de las circunstancias de mercado podremos salir antes de los stops pero no será una práctica habitual.

La distancia al stop siempre será menor que la distancia al objetivo de beneficio

GESTIÓN EMOCIONAL

Después de años de afrontar a diario los mercados financieros, una de las conclusiones fundamentales a la que hemos llegado, es que para tener éxito en el trading a largo plazo, sobrevivir financieramente y tener consistencia, es sin duda el dominio y correcta gestión de las emociones.

Es verdad, que en el trading automático, gran parte de la gestión emocional queda determinada por los algoritmos de los robots, sin embargo, nosotros tenemos el control en algunas decisiones estructurales, y que si no dominamos nuestros actos y hábitos podemos obtener pésimos resultados, como es el caso de los momentos de parar un sistema, cuándo optimizarlo, incluso de la adición de más sistemas a la cartera cuando los resultados van a favor, o arriesgar más de la cuenta ante una racha de operaciones ganadoras.

En la operativa totalmente discrecional, es donde más puede afectar la toma de decisiones basadas en aspectos emotivos.

Los 4 hábitos más nocivos que afectan a la actividad del trading y que debemos aprender a gestionar son:

- Esperanza de que una operación perdedora se gire a nuestro favor.
- Modificación de stops si la posición evoluciona en contra.
- Sobreoperación para contrarrestar una racha de pérdidas.
- Falsa percepción del riesgo en momentos de euforia por una racha positiva.

No es sencillo controlar las emociones cuando está en juego dinero real, pero debemos realizar ejercicios y terapias de control para acostumbrar a la mente a convivir diariamente con estas situaciones.

En cualquier metodología de trading, incluso en el trading automático, influye de una forma u otra la gestión y control de las emociones, más de lo que a priori puede parecer

CONCLUSIONES

- 1** En definitiva el análisis del mercado mediante flujos de divisas nos ayuda a identificar hacia dónde se están posicionando los operadores. Existen momentos del mercado en que estas fortalezas o debilidades de divisas son claras y será el momento de operarlas buscando una contraparte que corrobore una estructura gráfica susceptible de lograr rendimiento económico.
- 2** Debemos buscar siempre una media de operaciones ganadoras que sea superior en recorrido a lo que lo son la media de las operaciones perdedoras. Esto nos permite que con un porcentaje de aciertos bajo sigamos teniendo una esperanza matemática positiva.
- 3** La gestión de la posición es clave a la hora de tomar la decisión de la entrada en el mercado, en cuanto al tamaño y a la colocación de los stops. Recordemos de no arriesgar más de 2% por operación y colocar los stops de pérdidas más alejados que el último soporte o resistencia relevante, y el objetivo de beneficios colocarlo antes de una

resistencia en operaciones de compra y antes de un soporte en operaciones de venta.

4 Es necesario dominar ciertas emociones que incurren en el trading de forma nociva para conseguir permanecer en los mercados de forma constante. La mente humana está programada para conseguir resultados en el corto plazo y es necesario cambiar ciertas percepciones y hábitos conductuales erróneos que surgen cuando se piensa en dinero para llegar a ser realmente un trader pro.

Cualquier operador por el simple hecho de utilizar una operativa que a otro operador le funciona no va a obtener resultados de inmediato. El proceso es mucho más complejo y requiere de mucha práctica y habituar la mente a las condiciones de mercado.

Con el tiempo se pulen detalles de la operativa y del comportamiento además de ganar consistencia y habilidades.

No todos los operadores reaccionan de igual forma a la misma información ni adquieren las mismas habilidades. Con la práctica y la experiencia cada operador va asimilando aquellos aspectos que le son afines a su operativa y los adquiere como propios. Los sistemas cerrados con reglas inamovibles tienden a no ser rentable con el paso del tiempo.

Es por eso que hay que darle al trading en el mercado de divisas un enfoque global, para desarrollar la habilidad de ser más eficiente en las entradas, gestión y salidas de las operaciones.