

Un par de consejos para que profiles mejor tu sistema de trading

Por Enrique Díaz Valdecantos

En todo proceso de confección de un sistema de trading hay que decidir **qué tipos de entrada vamos a realizar**. Habrá traders, con un estilo algo más "agresivo", que prefieran operaciones que aún no tienen un contexto demasiado favorable pero con un potencial de recorrido mayor. Y otros, que sin embargo, prefieran operaciones que se enmarquen en un contexto más claro y con la línea de menor resistencia más definida, aunque para ello tengan que sacrificar parte del recorrido.

Dentro del primer grupo podríamos hacer entradas tipo "**taponcillo**" (vela de rango estrecho con mucho volumen al llegar a una zona de soporte/resistencia significativo) o tipo "**corte de mini o-H en correcciones de grado menor**". Y dentro del segundo, entradas tipo "**BACK con reacumulación/redistribución en C**" o "**cortes de B-Horizontal de correcciones más definidas**". Ninguna es a priori, mejor que otra. Todo dependerá de cómo nos sintamos al realizarlas. Lo importante es que todas cumplan con tres requisitos:

1. Que hayamos visto posicionarse con anterioridad al "**dinero profesional**".
2. Que tengamos claro donde está **la línea de menor resistencia**.
3. Y que **la oferta/demanda flotante se hayan retirado**.

Una vez sepamos nuestras "entradas ideales", deberíamos **ponerles nombres**. Esto puede parecer una tontería, pero ayuda a simbolizar pautas de mercado. Por ejemplo, en mi época de FHI llamábamos a las entradas "N1" y "N2", en su versión "conservadora" y "precoz". Aitor Zárata, a sus entradas les pone nombres extraños, como "no-name" o "conejito". O Paco Gómez, que utiliza frases como "una oveja en la M30", "descosio" o "estampitas", que nos ayudan a entender el mercado. Esta práctica podría parecer algo infantil pero créanme que no lo es.

Por lo tanto, el primer consejo sería "**poner nombres divertidos**" a las operaciones.

El segundo consejo es valorar **la calidad con las que las ejecuto**. Me explico. Una operación, básicamente, podemos ejecutarla de tres formas:

A. A la perfección: siguiendo todos los criterios preestablecidos.

B. Moderadamente bien: alguno de los requisitos me lo salto, aunque en su conjunto es una operación que se ajusta a sistema.

C. Rematadamente mal: ejecutadas sin seguir ningún tipo de regla.

Obviamente todas nuestras operaciones deberían ser tipo "A", pero somos humanos y algunas terminarán siendo tipo "B" y otras, por desgracia incluso tipo "C". Cuando hablamos de calidad no me refiero a ganar o perder. Ojo, eso es un factor que no podemos controlar en el momento de darle al botón de la entrada. **Hablamos de calidad a la hora de ceñirnos a las normas que nos hemos obligado a seguir**, independientemente que la operación salga positiva o negativa.

Realizar un estudio de nuestra operativa por calidad nos va a proporcionar algunos beneficios. Por ejemplo, el simple hecho de llevar un registro de nuestras operaciones nos incentivará a que nos ciñamos al sistema con mayor disciplina, o por ejemplo a darnos cuenta de si, efectivamente, cuando lo hacemos conseguimos mejores resultados.

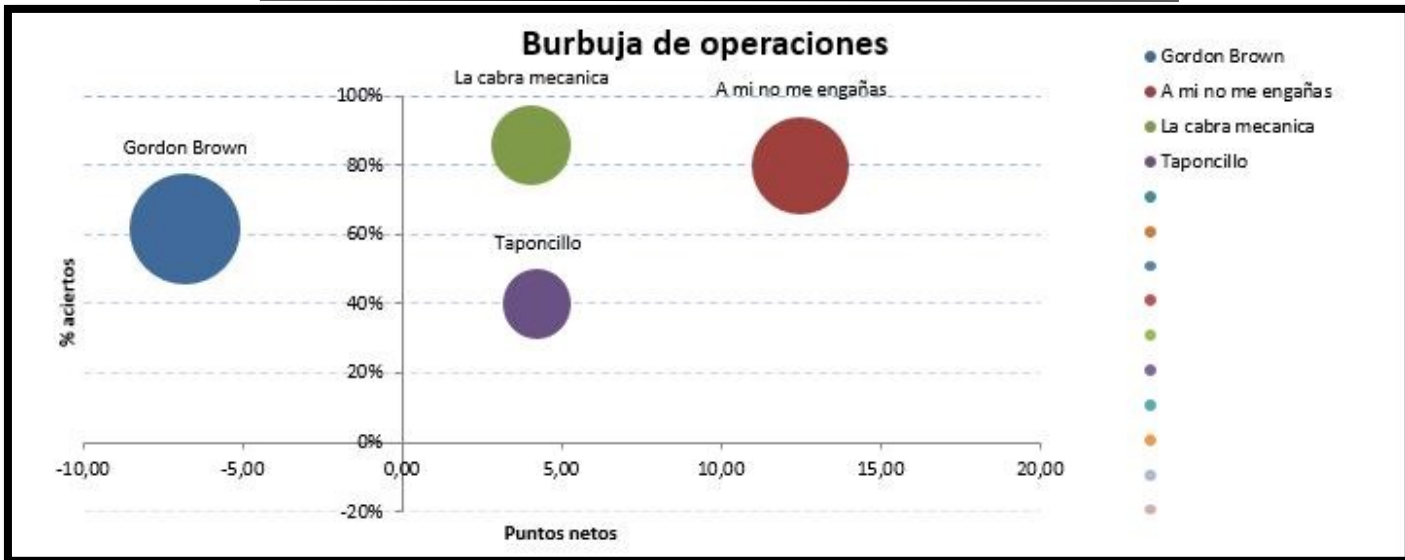
Si hacemos ambas cosas (poner nombres divertidos a las operaciones y medir la calidad de cada ejecución) podremos analizar mejor qué tal estamos operando y tomar decisiones del tipo: "dejo de hacer esta entrada porque siempre que la hago me precipito y acabo perdiendo", o, "sólo haré este tipo de operación porque su efectividad es muy elevada".

En la hoja **Excel** que le acabo de dar a los alumnos del curso online, estos se analiza de forma automática y muy eficiente. Por ejemplo, imaginemos que nuestras operaciones se llaman "**Gordon Brown**" (por ser la más conservadora), "**A mi no me engañas**" (la típica de volumen de parada que parece que se va a un lado con intención y era justo lo contrario), "**La cabra mecánica**" (mi corte de O-Horizontal, porque hay que estar como una cabra para hacerla) y "**Taponcillo**".

Pues bien, en base a los resultados que nuestra Excel nos aporta (y que podemos ver en el cuadro de abajo) podríamos llegar a la conclusión de que tenemos que dejar de hacer las entradas tipo "Gordon Brown" y buscar más las "a mi no me engañas".

Tipo de operación	Trades		Win	Loss	W/P	Payoff	Media P. Bto(+)	PP. Netos
	35		24	11	69%	0,88	3,53	14,00
Gordon Brown	13	37,14%	8	5	62%	0,19	0,47	-6,80
A mi no me engañas	10	28,57%	8	2	80%	1,53	1,97	12,50
La cabra mecánica	7	20,00%	6	1	86%	0,49	1,13	4,05
Taponcillo	5	14,29%	2	3	40%	2,76	4,75	4,25

Analizando esto mismo en un gráfico de burbujas vemos cómo la entrada "a mi no me engañas" acierta muchas veces y da muchos puntos.

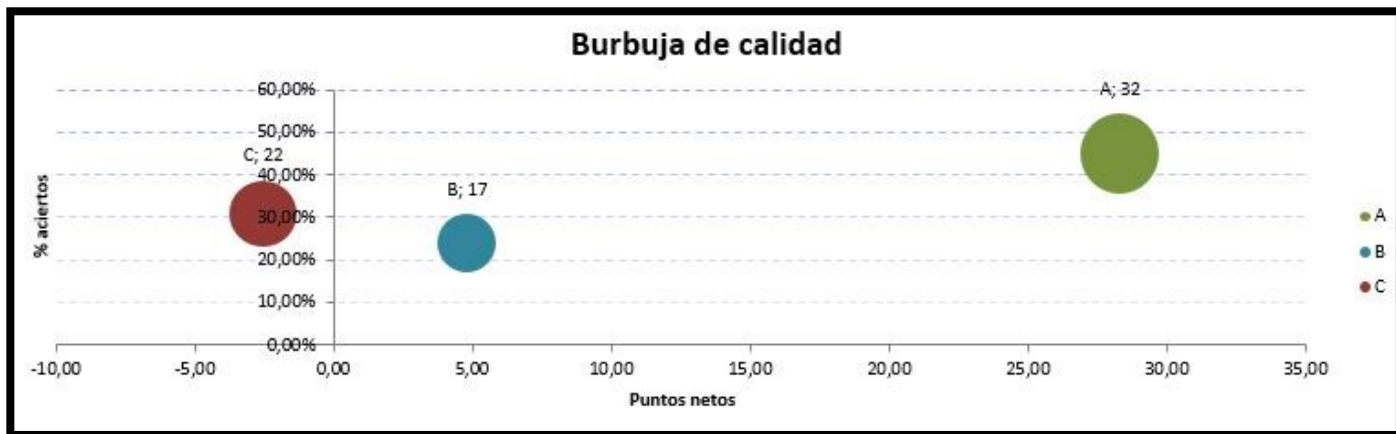


En cuanto a la calidad, podemos ver como las tipo A, efectivamente nos aportan casi todos los beneficios, con un

	Total	%	Neto	Win	%	Loss	%
A	32	45,07%	28,30	24	75,00%	8	25,00%
B	17	23,94%	4,80	12	70,59%	5	29,41%
C	22	30,99%	-2,55	10	45,45%	12	54,55%
	(71)			(46)		(25)	

porcentaje de aciertos muy elevado (75%), y en cambio, las tipo C, solo nos traen penurias.

O analizando esto mismo con burbujas vemos cómo las tipo A van muy bien y merece la pena ceñirse al sistema.



En definitiva, definir un sistema es algo más complejo que solo esto, pero empezar por nominar las entradas y medir el grado de efectividad al ejecutarlas es un buen paso para empezar a trabajar. Te animo a que lo hagas, apunta tus operaciones y luego analiza los resultados. Esto te ayudará a conocer tu sistema y a valorar qué cosas tienes que cambiar o qué cosas tienes que potenciar.

Espero que te haya servido de ayuda este artículo.

Nos vemos en Chicago.