

¿QUÉ ES UN SISTEMA DE TRADING?:

La definición de un sistema, en cualquier ámbito, es en sí misma, un conjunto de herramientas y componentes que funcionan al unísono para conseguir un fin, o por el contrario, son un fin en sí mismo. Toda la naturaleza se desarrolla en subsistemas, unos con otros, componen un sistema más complejo y global. Todos se interrelacionan y cada uno tiene sus herramientas, reglas y pautas de comportamiento y se mantiene en equilibrio.

Un sistema de trading, no es ni más ni menos que lo mismo. Al igual que la naturaleza, se compone de herramientas. “En nuestro caso, los sistemas se soportan en la estadística”. Unos componentes actúan sobre otros componentes del sistema, “que se denominarán variables”; trabajamos sobre las barras que representan los movimientos del precio de los activos en el mercado. Estas representaciones, que son más visuales en forma de gráficos de precios bidimensionales: precio/tiempo; son la única unión objetiva que tenemos con cada uno de los activos universales sobre los que queremos interactuar.

Les explicamos mejor. Cada movimiento de precio, deja una huella de interés comprador o vendedor. El denominado “efecto del cuidador” tiene normalmente tacto para evitar rangos de precios comprometidos a las ventas masivas de títulos y a su vez, en la realización de distribuciones de títulos, se encarga de hacerlo de manera ordenada para evitar el desplome instantáneo de las cotizaciones. Cada título/valor tiene uno o varios de estos mencionados. Esto nos da una zona de soporte y otra de resistencia. A partir de ahí ya tenemos un ejemplo del porqué las cotizaciones de los precios son nuestra unión objetiva al mercado. En la evolución de los precios se observa la existencia de noticias relevantes para los valores, así como por ejemplo, la información privilegiada, penada por la ley pero claramente utilizada masivamente en los mercados y siempre en perjuicio del pequeño ahorrador.

Y como no, mentar que desde el desarrollo de la herramienta que posibilita el acceso prácticamente en tiempo real a todos los mercados globales, que no es otra que internet, invertir en los mercados de valores es posible para cualquier interesado en la materia.

A la vez que se desarrolló internet, los brokers online, se han convertido en intermediadores cada vez más económicos y eficaces para el inversor particular hasta el punto de tenerlos a nuestra disposición para “operar en corto” vendiendo acciones de empresas casi de cualquier parte del mundo sin haberlas comprado primero, con el objetivo de comprarlas una vez que su precio sea inferior al precio de la venta previa “cerrar la operación corta”.

Ofreciéndonos a parte de la inversión directa en acciones de empresas cotizadas, los contratos de CFD’s, traducido al español “contrato por diferencia” (Contract for Difference, CFD) que son contratos por los que se intercambia la diferencia de valor de un instrumento financiero en el momento de la apertura del contrato y su valor en el momento de cierre del mismo. Este instrumento da acceso a la negociación de operaciones con mucho apalancamiento. No es de antemano nuestro objetivo, sino mucho más lejos del 2x1 (doblar

las posiciones de efectivo, solo en el caso de aquellos especuladores más agresivos daríamos tal opinión si cumplen el perfil de riesgo) y en su momento se explicará el porqué de doblar la posición. En todo caso, no recomendamos apalancarse, y menos, sin contar con nuestra opinión previamente.

Nuestra operativa diaria, encajando más en la definición de “daytraders” que otras, se desarrolla en el mercado de futuros. El mercado de acciones/Cfds, lo desarrollamos en menor medida debido más que a otras cosas al coste de oportunidad.

Un contrato de futuros es un contrato o acuerdo que obliga a las partes contratantes a comprar o vender un número determinado de bienes o valores (activo subyacente) en una fecha futura y determinada y con un precio establecido de antemano. En resumen, representan un activo subyacente y en todo caso, nuestro objetivo no es comprarlo. Nuestra operativa se cierra todos los días. Entramos al mercado cuando se cumplen ciertos requisitos que establecemos mediante nuestra herramienta estadística y en cualquier caso, antes del cierre diario del mercado nuestra operación se cierra. Si ese día nuestro negocio cerró en el objetivo, ganaremos los puntos estimados hacia el objetivo. Si el negocio cerró en nuestro stop, perderemos los puntos estimados hacia el stop. Si no toca el precio ni el objetivo, ni el stop, cerraremos la posición a la hora que determine el sistema. Así de fácil es operar en los mercados de futuros!!

Siendo francos, desarrollar operativas basadas en sistemas resulta extremadamente complicado de estudiar y aprender. Operar en los mercados de futuros es muy fácil en los tiempos que corren; pero, ganar dinero en los mercados de futuros, es muy difícil si no se tienen los conocimientos necesarios o en su defecto nos los aporta una tercera persona y en tiempo real.

Saludos,

Equipo BDI