



MÉTODO TRADING

HISPATRADING
GUÍAS



04

SISTEMAS DE TRADING

EDITOR
Alejandro de Luis

COMITÉ DIRECTIVO
Elimelech Duarte, Alejandro de Luis

ADMINISTRACIÓN
Keneth Duvan Alarcón

INTÉRPRETE
Diana Helene Castillo

TRADUCCIÓN
Alberto Muñoz Cabanes

EDICIÓN
Editorial Hispafinanzas

MAQUETA
Luis Benito Grande

© Editorial Hispafinanzas
All rights reserved
www.hispafinanzas.es

El trading y la operativa en bolsa conlleva un alto riesgo y por tanto podría no ser adecuado para todo tipo de inversores. El objetivo de este magazine es proporcionar al lector herramientas e información que contribuyan a su formación para comprender los mercados financieros. Sin embargo, los análisis, opiniones, estrategias y cualquier tipo de información contenida en este magazine es ofrecida como información general y no constituye en ningún caso algún tipo de sugerencia o asesoramiento financiero.

Hispatrading Guías se exime de cualquier responsabilidad por pérdidas o perjuicios causados en las inversiones que realice el lector por el uso de la información o contenidos aquí ofrecidos. Así mismo la editorial de este magazine no asume responsabilidad por las opiniones o información emitidas por los colaboradores, anunciantes y demás personas que utilicen este medio para emitir sus opiniones.

Hispatrading® es una Marca Registrada y los contenidos de Hispatrading Guías son exclusivos. Quedan reservados todos los derechos. Queda rigurosamente prohibido reproducir, almacenar o transmitir alguna parte de esta publicación, cualquiera que sea el medio empleado (electrónico, mecánico, fotocopia, grabación, etc.), sin autorización escrita de los titulares del copyright bajo las sanciones establecidas en las leyes españolas e internacionales sobre copyright.

SUSCRÍBASE GRATIS:

WWW.HISPATRADING.COM

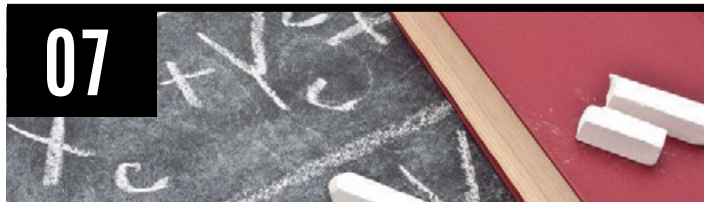
DISEÑO DE SISTEMAS DE TRADING

02



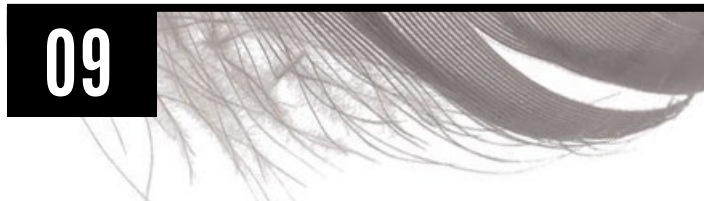
LA ESPERANZA MATEMÁTICA POSITIVA

07



LA IMPORTANCIA DE LA SUAVIDAD EN LA CURVA DE BENEFICIOS

09



OPTIMIZACIÓN DE SISTEMAS DE TRADING AUTOMÁTICO

13





CÓMO CREAR UN SISTEMA DE TRADING OPERANDO COMO UN ROBOT

Una de las ramas del trading es la operativa sistémica o trading con sistemas. Mediante esta forma de operar intentamos predefinir unas reglas fijas, que nos indiquen todos los parámetros necesarios, para poder realizar una operación sin la intervención humana.

Es por eso, que el trading con sistemas es el contrapunto al trading discrecional, en el que el trader juega un papel fundamental tomando siempre la última decisión.

Pero ¿qué factores debo tener en cuenta para crear un sistema? ¿Por dónde empiezo? Son algunas de las preguntas que todo aquel que quiera crear un sistema debe saber responder. En este manual podrá conocer las respuestas y crear así un buen sistema de trading. ■



~ DISEÑO DE SISTEMAS DE TRADING

Diseñar un sistema consiste en analizar y estructurar una forma o método de operar en los mercados siguiendo una estrategia de manera sistemática.

POR JOAN MARCEL DURAN

El objetivo de este artículo es explicar una metodología que facilite la comprensión y automatización de un sistema, mostrar las distintas fases y componentes de la tarea de mecanizar un sistema puede permitir al lector formarse una idea más clarificadora de este "sector" del mundo de la inversión y especulación. Poder diseñar tu sistema, el sistema que cada día ejecutas delante de la pantalla, facilita enormemente el siguiente paso: su automatización, ¡Sí!, es posible mecanizar un sistema de inversión, es posible mecanizar una estrategia especulativa en los mercados, pero antes de nada vamos a ver porqué es aconsejable el diseño de un sistema de trading.

Antes de entrar en materia, es bueno entender sus principales ventajas:

¿POR QUÉ ES IMPORTANTE LA FASE DE DISEÑO?

1. Racionalizar la estrategia, no conviene dejar ningún supuesto al azar

2. Identificar los componentes y variables que dan vida al sistema
3. Documentar nuestras ideas o estrategias de trading

¿QUÉ BENEFICIOS OBTENEMOS DEL DISEÑO?

1. Nuestros sistemas estarán mejor pensados, mejor preparados, en definitiva más robustos
2. Nos servirá como guía o plan de trading
3. Facilitará su automatización en posteriores fases

Diseñar un sistema no es ni más ni menos que analizar y estructurar una forma o método de operar en los mercados, por lo tanto solo será posible si sabemos que seguimos una estrategia repetidamente o mejor dicho, sistemáticamente. Como punto de partida tendremos esa estrategia que ponemos en práctica cada vez que operamos o esa idea que hemos leído en alguna ►



Figura 1. Entradas y salidas de un sistema automático de trading

- web o foro, en este artículo no os voy a contar ninguna estrategia en concreto, en lugar de eso os voy a dar algunas pautas y recomendaciones sobre cómo plasmarla en un papel para que pueda ser automatizada por uno mismo o por un tercero. Empecemos por la definición de sistema.

De la RAE, en su primera acepción de la definición de sistema:

1.m. Conjunto de reglas o principios sobre una materia racionalmente enlazados entre sí.

En nuestro caso la “materia” está más que clara: el Trading, por “conjunto de reglas” poco que añadir, excepto la necesidad de que un sistema cumpla con ciertas pautas o reglas para las cuales fue creado, en cuanto a “racionalmente enlazados entre sí” nos exhorta a seguir una determinada lógica y coherencia en su conjunto.

Muy científico y muy genérico, pero más concretamente y llamadamente ¿qué es para nosotros?, ¿qué entendemos por sistema de trading automático? Visto desde fuera un sistema de trading automático es una caja negra alimentada por una serie de datos que acaban transformándose en operaciones en el mercado produciendo resultados económicos en nuestra cuenta, si lo representamos de forma gráfica:

En la *Figura 1* podemos observar una caja opaca que esconde las reglas o lógica del sistema y donde figuran sus entradas y salidas, por una parte tenemos como entrada los datos provenientes de los mercados (cotizaciones, volumen negociación, etc.) y por otra también tenemos los parámetros de configuración del sistema que nos servirán para realizar los ajustes a las condiciones particulares del instrumento.

Por otro lado y respecto a la salida tenemos los resultados, básicamente son de dos tipos, los resultados históricos que son datos estadísticos basados en las operaciones realizadas sobre el histórico de cotizaciones también denominado backtesting, y los reales, ya que cuando empezamos a operar con el sistema los resultados pasan de ser históricos a cargarse en nuestra cuenta en forma de pérdidas y ganancias.

Un sistema de trading antes de convertirse en una caja negra ha pasado por varias etapas antes de llegar al usuario o consumidor final (aunque sea uno mismo) como son el diseño, desarrollo, pruebas, optimización y puesta en marcha. Como he comentado previamente hemos de partir de una estrategia o idea de trading para proceder a su diseño.

En la *Figura 2* vemos un esquema de los pasos que se siguen para completar la automatización de un sistema, si bien, no es lineal puesto que las fases de pruebas y optimización se retroalimentan, sí nos permite hacernos una idea del trabajo que conlleva. Los elementos clave a tener en cuenta para el diseño básicamente son tres: las variables de trabajo, la gestión de la entrada y la gestión de la salida.

Las variables de trabajo son aquellos datos imprescindibles para llevar a cabo nuestro trading o la construcción del sistema, bajo ►



MÉTODO TRADING



REGÍSTRESE A MÉTODO TRADING

**Y ACCEDA AL CONTENIDO
COMPLETO DE LA GUÍA**

REGÍSTRESE GRATIS