

TRADING ALGORITMICO

Python y MT5

Sebastián Ospina Valencia
Msc Economía Universidad de Antioquia

AGENDA



Universidad del
Rosario

Educación Continua
y Consultoría

1. Indicadores Técnicos
2. Tipos de Indicadores
 - a) Tendencia
 - b) Osciladores
 - c) Volumen
3. Otros Indicadores
4. Implementación y diseño de indicadores
 - a) Profundidad de Mercado (Aprox)
 - b) Soportes y Resistencias (aprox)
 - c) Línea Suavizada

Indicadores Técnicos



Universidad del
Rosario

Educación Continua
y Consultoría

Son valores que nos señalan una características del mercado que pueden ser utilizados para refinar las estrategias.

En general tienen como base una fórmula matemática y en algunos casos una 'fórmula estadística.



Tipos de Indicadores

Indicadores de Tendencia



Universidad del
Rosario

Educación Continua
y Consultoría

Son indicadores que tienen como objetivo capturar la
tendencia del activo.

En general usan promedios para esto

Algunos indicadores de Tendencia



Universidad del
Rosario

Educación Continua
y Consultoría

Algunos indicadores son :

1. Medias Móviles
2. Bandas de Bollinger
3. Ichimoku

ShortFalls de los Indicadores



Universidad del
Rosario

Educación Continua
y Consultoría

Es difícil encontrar, de manera manual, un parámetro que indique verdaderamente la tendencia del mercado. Normalmente se necesita un análisis de más de una media en distintos timeframes

Tienen poco/moderado poder predictivo

Osciladores



Universidad del
Rosario

Educación Continua
y Consultoría

Son indicadores que tienen por objetivo medir las oscilaciones del mercado.

Tipos de Osciladores



Universidad del
Rosario

Educación Continua
y Consultoría

1. RSI
2. Estocástico
3. MACD

ShortFalls de los Indicadores



Universidad del
Rosario

Educación Continua
y Consultoría

Su principales dificultades están en que los valores críticos no se definen con un criterio claro.

Poseen un poder predictivo bajo/moderado

Indicadores de Volumen



Universidad del
Rosario

Educación Continua
y Consultoría

Son indicadores que tienen como objetivo medir el interés de compradores y/o vendedores de un activo en determinado punto del tiempo.



Tipos de Indicadores de Volumen

- Volumen
- Volumen al Balance
- Money Flow Index

ShortFalls de los Indicadores



Universidad del
Rosario

Educación Continua
y Consultoría

En general mide el volumen de compradores y vendedores de manera agregada en un punto del tiempo. Sin embargo no precisa la dirección de este movimiento ni lo relacionan con el precio.

Tienen un poder predictivo bajo



Universidad del
Rosario

Educación Continua
y Consultoría



Otros Indicadores



Otros Indicadores

- Desviación estándar
- Average True Range
- Rango Intercuartil
- Oscilador estadístico



Universidad del
Rosario

Educación Continua
y Consultoría



Universidad del
Rosario

Construyendo Indicadores Personalizados



Vamos a construir:

- Profundidad del Mercado (Aproximada)
- Soportes y Resistencia (Aproximada)
- Suavizamiento



Universidad del
Rosario

Educación Continua
y Consultoría

Gracias