

Trading Algoritmo

Team

July 2022

1 Reunión del 8 de julio

1.1 Tareas pendientes

1. (Pipe): Hacer el tutorial para la descargar del Broker XM los datos para un periodo de tiempo o tiempo real. Canal Andrés
2. (Alejo y Mauro): Aclarar los conceptos del glosario.
3. (Cami & Sebas): Replicar el ejercicio que se hizo con datos de mayor frecuencia. Se requieren los datos con la granularidad.
4. (Cami & Sebas): Implementar las estrategias (Camilo y Sebas)
5. (Cami & Sebas): Definir con Juan lo del repo colectivo (Sebas, Camilo & Adri).

1.2 ¿Qué se hizo?

1. Socializo los parámetros del experimentos. Quedaron así: (Subir la Tabla, Alejo y Mauro) . Entregaron: Mauro, Alejo y Adri.
2. Diagnóstico para realizar la prueba en Metatrader5. R/ se puede. Realizar un Monto a pagar por el servicio. R/ No hay que pagar por correr los programas de TA. Entrega: (Andrés)

1.3 Estrategias propuestas

1. **Adriana:** Medias móviles con diferentes cortes: 8, 21 exponenciales. Marcos de tiempo en 5 minutos, 1 hora, 4 horas y diario. Cuando la de 8 corte a la de 21 hacia arriba compra y lo opuesto se vende. Se comparan: 8 y 21.
2. **Alejo:** Combinación entre media de corto plazo, bandas de bollinger y RSI. Si el RSI es mayor que 50 y la media corto plazo corta hacia arriba la media de 20, Se compra. Si el RSI es menor que 50 y la media de corto plazo corta hacia abajo la media de 20, se vende.

3. **Mauro:** Señales en base del RSI de 5 y 14 periodos. Los cruces deben darse en 30 y 70. Si el RSI de 5 cruza de abajo hacia arriba. El RSI de 14 compramos si estamos en zona de sobreventa (RSI \leq 30). El comportamiento contrario vendemos, si estamos en zona de sobrecompra (RSI \geq 70). Velas Heiken Ashi. 3 subiendo compre. 3 bajando venda. Mauro propone una señal de take: 1.5 o 2.5% movimiento del activo.
4. **Camilo:** Ángulos entre los precios de los últimos 7 días que junto con las medias darían la señal de compra o venta.
5. **Sebas:** Varianza entre el máximo y el mínimo. La varianza confirma la señal
6. **Andres:** Se definen corridas con el mismo patrón (subidas o bajadas). Ej: si baja 3 veces consecutivas compro. Si sube 3 veces vendo. En la figura adjunta está la tabla.

2 Reunión 24 julio

Se socializan los avances de las tareas de la reunión anterior.

1. Mauro y Alejo socializan con Andrés algunos conceptos claves.
2. Camilo revisa la estrategia de Adriana y no arroja buenos resultados. Mauricio sugiere hacer el cierre con otra metodología.
3. Camilo descarga algunos datos con el *scrip* que compartió Andrés. La columna de precios de cierre aparece vacía.
4. Se decide abrir el repo de github.
5. Andrés socializa que no se pueden hacer pruebas con el probador de estrategias, se puede hacer escribiendo en *MQL5*. Se puede montar la estrategia en la cuenta demo.

2.1 Tareas

- Iniciar con una revisión en la literatura para ir nutriendo las estrategias.
- Andrés queda en revisar por que le precio de cierre se está descargando.

3 Links

- Link para descargar datos. Canal Andrés
- Repositorio Repo.
- Camilo precio de cierre *MQL5*