

Day Trading 2

El documento titulado "Intraday Strategies" se enfoca en estrategias para el trading intradía, destacando las diferencias clave con el trading a largo plazo y ofreciendo una guía paso a paso para construir estrategias efectivas. A continuación, se presenta un resumen traducido al español, sección por sección:

Construyendo Estrategias Intradía (Paso a Paso):

Esta sección introduce las diferencias fundamentales entre el trading intradía y el seguimiento de tendencias a largo plazo, enfatizando la importancia de la frecuencia de los datos (por ejemplo, barras de 5 o 15 minutos) y cómo esto cambia el enfoque de las estrategias hacia el ruido del mercado, patrones repetitivos y el comportamiento de los traders. Se sugiere revisar el capítulo anterior sobre la construcción de una estrategia de tendencia y se destaca la importancia de los costos de trading y la ejecución en tiempo real.

Las Ventajas de Operar Menos Frecuentemente:

Explora cómo algunas estrategias intradía buscan configuraciones específicas de patrones que, aunque pueden no desencadenar operaciones frecuentes, generan ganancias en un alto porcentaje de casos. La diversificación de estrategias y la adaptación de la estrategia al mercado adecuado son discutidas como componentes cruciales del éxito en el trading.

El Marco Temporal:

Detalla cómo decidir el tamaño de las barras (en minutos) para las operaciones, con un enfoque en cómo los marcos temporales más cortos pueden aumentar el ruido y afectar los retornos. La frecuencia de los datos y la estrategia seleccionada deben alinearse para capturar patrones de gráficos efectivos.

Esquema General:

El proceso de desarrollo de una estrategia intradía es esencialmente el mismo, con quizá un paso adicional para distinguir entre los mercados que requieren reversión a la media en lugar de una preferencia tendencial. Algunas de las decisiones exclusivas que hay que tomar son:

- El tamaño de las barras de precios en minutos.
- La calidad de la tendencia del mercado para decidir sobre la reversión a la media, el comercio direccional, o una combinación.
- La ventana de tiempo en la que opera. ¿Quiere operar sólo en las primeras 4 horas o en las últimas 4 horas? Algunos operadores, como Linda Raschke, creen que la acción de los precios

por la mañana tiende a ser ruidosa, mientras que los movimientos de los precios por la tarde tienen más tendencia.

- ¿Va a mantener la operación durante la noche o se trata de una operación diaria?
- Si opta por una operación diurna, ¿dejará de entrar en operaciones después de una hora determinada (antes del cierre)?
- Si mantiene la operación durante la noche, ¿podrá ejecutar una operación si la señal se produce al cierre de hoy?
- ¿Operará cuando la volatilidad sea extremadamente alta o baja?
- ¿Son mejores los resultados cuando las señales van precedidas de un inside day (una barra con un máximo más bajo y un mínimo más alto)?
- ¿Debe operar sólo en la dirección de la tendencia diaria?

También hay que tener en cuenta el tamaño de la posición, la recogida de beneficios, los stop loss y otros controles del riesgo. Algunas de estas características son las mismas que en el Capítulo 23. Con todas estas opciones para probar, necesitaremos que asignar valores razonables a algunas de ellas para reducir el proceso. reducir el proceso.

Por ejemplo, ¿queremos filtrar las operaciones en la dirección de la tendencia? Si ésta es la única estrategia con la que opera, entonces sí, porque la tendencia puede añadir fiabilidad y aumentar el tamaño de sus beneficios. Pero si usted tiene múltiples estrategias, a continuación, añadir una tendencia hará que el rendimiento de un sistema intradía altamente correlacionado con otros sistemas que tienen un componente de tendencia. Eso reducirá el beneficio de utilizar diferentes estrategias.

También podemos optar por mantener una operación durante la noche para aumentar las posibilidades de obtener un beneficio mayor. Entonces no necesitaremos decidir la última hora del día para entrar en una operación porque se nos debería permitir entrar hasta el cierre. Aun así, no operar en la última señal de 15 minutos del día puede ser práctico.

Como se habrá dado cuenta, no podemos probar todas estas opciones. Simplemente empezaremos por el principio con una estrategia sencilla y las características más importantes y veremos cómo evoluciona.

Volumen y Volatilidad Intradía:

Se enfoca en cómo los patrones de volumen y volatilidad durante el día son cruciales para los traders intradía, con ejemplos específicos de cómo estos patrones difieren entre mercados como el NASDAQ y el Eurobund.

Breakout de N Barras y Sistema de Breakout de Volatilidad:

Presenta estrategias basadas en breakouts, tanto de N barras como de volatilidad, incluyendo reglas específicas y resultados de pruebas que demuestran la efectividad de estas estrategias en diferentes condiciones de mercado.

Expandiendo el Concepto:

Se traslada la discusión a futuros, ofreciendo una estrategia que aprovecha el apalancamiento para apuntar a movimientos de precios más pequeños, con un enfoque específico en la reversión a la media.

Cualificaciones y Expectativas:

Discute las expectativas realistas para las estrategias intradía y cómo ajustarlas basándose en la volatilidad diaria en lugar de la intradía para determinar el tamaño de la posición y los niveles de toma de ganancias.

La Regla de Breakout y El Comercio Direccional:

Explora cómo las estrategias de breakout y los comercios direccionales pueden ser aplicados utilizando diferentes umbrales basados en la apertura del día actual o el cierre del día anterior.

El Comercio de Reversión a la Media:

Examina cómo las estrategias de reversión a la media pueden ser particularmente rentables en mercados con alto ruido, como el índice S&P.

Tenerlo de Ambas Maneras:

Propone una estrategia híbrida que combina elementos de breakout y reversión a la media para maximizar las oportunidades de trading en un solo día.

Ajustando la Volatilidad:

Aborda cómo ajustar las estrategias basadas en la volatilidad de diferentes mercados para equilibrar el riesgo y mejorar los retornos.



Un Sistema Intradía Basado en un Patrón de Gráfico:

Introduce una estrategia basada en la divergencia intradía y el indicador de fuerza relativa (RSI) para identificar puntos de entrada y salida basados en la pérdida de fuerza en los movimientos de precios.

Este documento proporciona una guía comprensiva para construir y ajustar estrategias de trading intradía, utilizando ejemplos específicos y resultados de pruebas para demostrar cómo diferentes enfoques pueden ser aplicados en diversos mercados y condiciones de trading.