

	PLAN DE SISTEMA DE TRADING	Ed/Rev	2011A
		Fecha	2019
		Hoja	

NOMBRE DEL SISTEMA: BOUL 2020

1) IDEA

Concepto: El sistema intenta capturar los movimientos alcistas producidos durante la noche en los índices de acciones. En dichos movimientos se produce una parte importante de la rentabilidad de los índices. La estrategia ha sido diseñada para operar sobre futuros de índices US.					
Tipo Sistema:	Pauta Nocturna + reversión	Resultados Previstos:	CAROR > 15% DD < 20%	Timing Previsto:	De 10 min a 40 min

2) CONSTRUCCION DEL SISTEMA

Setup	El precio del cierre producido hoy a las 22:00h es inferior al precio de cierre producido ayer a las 22:00h. Y el indicador CMO está por debajo de cierto umbral.
Ptos. Entrada	Entramos una vez que ha finalizado la primera barra de la siguiente sesión.
Ptos. Salida	Si la tendencia de largo plazo es bajista cerraremos la posición a primera hora de la mañana (Por defecto: 9:30h Horario Madrid). Si la tendencia de largo plazo es alcista cerraremos la posición antes del inicio de la sesión según el horario regular de los índices US (Por defecto: 15:00h Horario Madrid).

Stop Loss	<p>Se coloca un Stop Loss porcentual ceñido cuando la entrada se haya producido en un entorno bajista.</p> <p>Se coloca un Stop Loss porcentual más amplio cuando la entrada se haya producido en un entorno bajista.</p>
Money Management	<p>No implantado (F óptima, Fixed Ratio y Fixed Fraction en próximas versiones).</p>
Código en NinjaScript	<pre>protected override void OnBarUpdate() { // COMPROBAMOS QUE HAY SUFICIENTES BARRAS if (CurrentBar < 50) return; // SALIDAS HORARIAS int ETD = 93000; // Fin de la Pauta int ETU = 150000; // Pauta Extendida // FILTRO PULLBACK // Obtenemos el precio de cierre de hoy if(ToTime(Time[0]) == 220000) CloseToday = Close[0]; // Obtenemos el precio de cierre de hoy con una barra de retraso if(ToTime(Time[0]) == 223000) CloseYesterday = Close[1]; // Comparamos ambos precios de cierre a las 22:00 if(ToTime(Time[0]) == 220000) { if (CloseToday < CloseYesterday)</pre>

```

        {
            Pullback = true;
            BackBrushAll = Brushes.PaleGreen;
        }
        else
        {
            Pullback = false;
            BackBrushAll = Brushes.Pink;
        }
    }

    // SI ESTAMOS FLAT
    if (Position.MarketPosition == MarketPosition.Flat
        && Bars.IsFirstBarOfSession
        && Time[0].DayOfWeek != DayOfWeek.Sunday
        && Pullback
        && CMO(CMOPeriod)[0]<CMOLevel

        )
    {
        if(Close[0] > SMA(SMAPeriod)[0])
        {
            Tendencia = true;
            EnterLong(1, "Enter Up Trend");
            SetStopLoss("", CalculationMode.Percent, StopTrendUp/100,
false);
        }
    }

```

```
else
{
    Tendencia = false;
    EnterLong(1, "Enter Down Trend");
    SetStopLoss("", CalculationMode.Percent, StopTrendDown/100,
false);
}

}

// SI ESTAMOS LARGOS
if (Position.MarketPosition == MarketPosition.Long)
{
    if(Tendencia)
    {
        if (ToTime(Time[0])>= ETU)
        {
            ExitLong("Exit Up Trend", "");
        }
    }
    else
        if (ToTime(Time[0])>= ETD)
        {
            ExitLong("Exit Down Trend", "");
        }
}
}
```

**Ejemplo de
operaciones en
tendencia alcista**



**Ejemplo de
operaciones en
tendencia bajista**

