Contenido

[Semana 1 1](#_Toc93508120)

[Estrategias de trading básicas 1](#_Toc93508121)

[Objetivos 1](#_Toc93508122)

[Entradas y salidas de trading 1](#_Toc93508123)

[Reglas endógenas o exógenas 2](#_Toc93508124)

# Semana 1

## Estrategias de trading básicas

### Objetivos

* Identificar los diferentes tipos de entradas y salidas en las estrategias de negociación.
* Distinguir entre reglas comerciales exógenas y endógenas.
* Construir una estrategia de comercio básico

### Entradas y salidas de trading

|  |  |
| --- | --- |
| Traiding algorítmico | Trading sistemático |
| Objetivo | Subjetivo |
| Tiene métricas | Se basa en opiniones y sentimientos |
| Gestión de riesgos pre-planificada | Obtener ganancias sin importar el riesgo |

Reglas de entrada al comercio

* Puede ser endógeno o exógeno o ambos
* Las reglas endógenas se basan únicamente en el desempeño de la seguridad que está comercializando

### Reglas endógenas o exógenas

Regla de entrada comercial endógena

Gráfico, Gráfico de líneas

Descripción generada automáticamente

Gráfico, Gráfico de líneas

Descripción generada automáticamente

Se basan en los datos del precio o del volumen

Un ejemplo seria "Compre Apple si el volumen excede el volumen del día anterior y el precio de cierre es más bajo que el promedio diario".

Gráfico, Gráfico en cascada

Descripción generada automáticamente

Regla de entrada de comercio exógena

* Utiliza datos distintos del precio y el volumen.
* "Compre Apple si el precio de Microsoft cae 5%".

Regla de entrada comercial exógena con datos macroeconómicos.

* "Compre Apple si la tasa de desempleo de los Estados Unidos disminuye".
* Optimismo = Precios de capital más altos
* Impulsado por la información macro liberada en un horario pre-especificado

Endógeno vs exógeno

Endógeno:

* ¿Son suficientes los precios de las acciones y los datos de volumen suficientes para ingresar a un oficio?
* ¿Pueden los patrones de precios pasados y los volúmenes predecir los precios futuros?
* ¿Hay información útil en la estructura de los datos en sí?
* ¿Puedes extrapolar los patrones de datos?
* Reglas endógenas a menudo basadas en el análisis técnico.

exógeno basado en:

* Precio de otros datos de seguridad o fundamentales o datos macroeconómicos.
* Síntesis de datos vs extrapolación.
* Se basan en variables "extra"
* Proporcionar mejores predicciones que el precio y el volumen solo.
* Ayude a elegir e incorporar variables adicionales a su modelo de negociación utilizando el aprendizaje de la máquina
* Reglas exógenas utilizadas por:
  + Grupos de comercio cuantitativo
  + Grupos de arb estadísticos
  + Estrategas

### Reglas de salida y estrategias básicas.

Profit exit es el precio de salida con una ganacia

Stop los es el precio de salida con perdidia (puedeser variable)

Las salidas por tiempo ocurren cuando los mercados solo operan en el día y en la noche se cierran las transacciones

Ejemplo de profit exit

1. "Hacer 25 puntos básicos".
2. Comprar a $ 100
3. Vender a $ 100.25

Configuraciones de un profit exit

* Establecer un nivel de salida de ganancias
  + Cubrir los costos del mercado
  + Difusión de ofertas
  + Comisiones de corretaje
* CUOTAS DE INTERCAMBIO
  + Se requieren retorno de retorno de capital de negociación

Para stop loss

* Siendo detenido
* Predicción incorrecta = Mercado se mueve contra ti
* Cerrar posición en la pérdida aceptable

"Cerrar posición si baja 150 bps".

* Entrar en $ 100
* Salir si el precio cae a $ 98.50

Los salidas de tiempo son opcionales y pueden usarse para:

* Gestionar el riesgo de posición
* Forzar una reevaluación de la estrategia periódica

Los stop los son obligatorias y son establecidas por el comerciante o impuestas por la gestión de riesgos.

Los stop los reducen riesgos:

* Cambios esperados en las condiciones del mercado:
  + Ruido en los precios
  + Aumentos en la volatilidad
* Cambios inesperados:
  + Fraude por gestión
  + Desastres naturales y riesgo político.

Nivel ideal de stop loss

El ruido del mercado puede desencadenar un stop los debido a la caída de precios temporales

* Común en mercados volátiles y menos líquidos.
* Los stop loss demasiado estrechas se limitan al riesgo, pero pueden desencadenar muchas pequeñas pérdidas
* stop loss no estrechos son menos sensibles al ruido, pero aumentan la exposición a grandes pérdidas

S / LS basado en movimientos de mercado y tolerancia al riesgo (dinámico)

* S / L sigue al precio alto en lugar del precio de entrada
* También puede ajustar el porcentaje de S / L

Encuentre el S/L óptima según bastesting.

* Usa tu modelo de 4 parámetros
* Modelo de backtest con datos del mercado:
  + L/S estática
  + L/s dinámica
  + L/S dinámica variable

Compare los resultados y elija un tipo óptimo de pérdida de parada