

Entrada en la Estrategia FDAX

El enfoque de la Estrategia FDAX se basa principalmente en la regresión a la media (reversión a la media). La estrategia, por lo tanto, establece un rango de operativa, con una amplitud ajustada en función de la volatilidad, en la que se marcan unas zonas de actuación para la entrada de posiciones largas o cortas. Se basan en años de experiencia y de observación de zonas donde habitualmente se producen correcciones (retroceso) hacia su precio medio y mas alla.

Diario de negociación:

Dos franjas horarias, de las 8 horas a 14:30h y 14:30h hasta las 22h. El mercado de USA tiene una gran influencia sobre el FDAX y empieza normalmente con noticias economicas publicados a las 14:30h (hora Madrid)

Toma de posiciones de 8 – 14:30h

1.Durante las franjas se abre una sola posición larga/corta en la primera zona de actuación. En la actualidad estas zonas están a 40 puntos del cierre día anterior/ apertura dia y, en función de variacion importante del VDAX-NEW se recalcula estas distancias de entrada y salida con las órdenes de límite o discrecionales. Objetivo de beneficio : de 30-40 puntos por cada posición abierta por un contrato.

2.La segunda zona está a una distancia de 40 puntos de la primera zona de actuación. En la segunda zona se abre posiciones largas /cortas con dos contratos. Eso significa que a veces las posiciones tomadas en la primera zona de actuación se encuentran en este momento soportando una pérdida. El objetivo de ganancias es de 30 -40 puntos, en donde se cerrarían los 3 contratos. Esto significa que la posicion abierta en la primera zona es cerrada con breakeven.

Posibles aperturas de posiciones hasta 14:30h :

- un contrato en la primera zona long
- un contrato en la primera zona short
- dos contratos en la segunda zona long
- dos contratos en la segunda zona short

3. En caso de que posiciones abiertas en la franja de 8-14:30h siguen en el mercado no se abren otras de la misma zona en la segunda franja.

4. En cuanto el VDA-NEW cotiza debajo de 20 se puede considerar de abrir una posicion larga en el area de cierre/apertura siempre que los DJIA FUT tienen tendencia en alza durante la noche que no gira al abrir el FDAX a las 8h. La primera zona de actuacion larga sera entonces la segunda.

5. Si debido a una noticia inesperada el precio cruza con una vela de 15m de un solo movimiento la primera zona, generalmente la larga, no entramos y entonces la segunda zona viene a ser la primera y anadimos otra zone que sera la segunda. Entradas solamente despues de un Reversal y habiendonos informado de la causa del movimiento. Estos moviemietos erradicos dan lugar de entrar segun la regla 80/20.



Toma de posiciones de 14:30 – 22 h

1.Después de las 14:30 h las tomas de posiciones en las zonas de actuación se abren cuando el precio cruza de abajo hacia arriba (para largos) o de arriba hacia abajo (para cortos) en dichas zonas.Cruzar incluye una vela que ha sido negociado fuera de las zonas y luego retrocede y cierra dentro de las zonas. Tecnicamente debe ser significativo.

2. Si después de una extensión de rango en la 2. zona se tomara una posición con 2 contratos, se activara una 3. Zona a la misma distancia que las anteriores, donde se entraría con 4 contratos, y aplicando en ese momento un time stop como se explica mas abajo.

Todas las posiciones todavía abiertas se cierran mas tarde a las 22h (puede haber posiciones que se encuentran entre zonas con perdida o beneficio)

Posibles aperturas de 14:30h – 22h :

- un contrato en la primera zona long
- un contrato en la primera zona short
- dos contratos en la segunda zona long
- dos contratos en la segunda zona short
- cuatro contratos en la tercera zona long
- cuatro contratos en la tercera zona short

Gestion de riesgo y proteccion de beneficios

Novicios de la estrategia deberian contentarse con 30/40 puntos dia.

Time Stop hasta 14:30h

Cuando se toman posiciones en la segunda zona de acción se aplica un stop de tiempo. Si después de la entrada y transcurridas 3 velas de 15M o después el precio se negocia con perdida de 10+ puntos se cerrarán todas las posiciones. Sin embargo mas tarde a las 14:30h. Esta situación se produce normalmente en días de tendencia.

Time Stop después 14:30h

Habiendo abierto una posición en la primera zona y posteriormente otra en la segunda zona conforme señala la regla de entrada entonces será aplicado el time stop.

Habiendo abierto una posición en la primera zona y posteriormente ninguna otra esta será cerrada mas tarde a las 22h.

En caso de que la primera entrada sera ejecutada en la segunda zona y en consecuencia una tercera entonces se aplicara el time stop en esta.

Como medida de seguridad, todo el mundo debe poner en su zona de confort un stop de protección de capital. Esto se aplica especialmente para posiciones largas en caso de un Cisne Negro.

Proteccion de beneficios / Gestión de riesgos

Es la naturaleza del trader de comprometer beneficios alcanzados con demasiada facilidad. Por tanto, es necesario implementar una estricta gestión de riesgos con el fin de asegurar el éxito a largo plazo.

Además del stop de tiempo ya en vigor aplicamos para proteger beneficios alcanzados la siguiente regla: (Explicaciones en los gráficos adjuntos para los dos últimos días operativos)

Stop para proteger beneficios previamente obtenido:

El parrafo 2 de la gestion de posiciones con la apertura de una tercera zona tiene un potencial de beneficios considerable pero tambien supone un riesgo alto durante dias de tendencia . Por consecuencia habiendo realizado un beneficio durante el dia y los DJIA Fut / US30 son negociados a la segunda zona > de 80 para entradas cortas y < de 80 para largos entonces preferimos no abrir nuevas posiciones.

Si una nueva posición se abre de acuerdo con el trade management establecido y a continuacion un benefico contable de unos 20 puntos es alcanzado un stop de proteccion de beneficios a la altura del precio de entrada sera activado.

Si una nueva posición se abre de acuerdo con el trade management establecido y esta es negociada con unos 20 puntos de perdida un Stop Loss es activado.

Los Stop losses aplicados son la mitad de puntos de las zonas en vigor.

Micro trading entre las zonas es muy individual y no está incluido en las estadísticas. Cada uno debe aplicar stop losses analógicas.

ADJUNTOS



Micro Trading

Dentro del rango de cotización y, en particular entre las zonas se puede realizar operativa Micro-Trading. El propósito de esta técnica es realizar un buen número de operaciones de menos ganancia. Es una gran herramienta para maximizar los beneficios.

En lugar de un contrato en la primera zona de acción y dos contratos en la segunda zona de acción, para esta técnica utilizamos 1 contrato mas y lo gestionamos de la siguiente forma:

Comenzamos generalmente con unos 10 puntos por encima (corto) o por debajo (largo) de las zonas de acción en curso..

Si una posición se cierra con beneficio y el precio regresa en o por encima de la última entrada se abre un nuevo contrato. Es muy posible que este procedimiento continua hasta la proxima zona de arriba o debajo haciendo una escalera.

La entrada puede ser manejada de manera muy eficiente utilizando velas heikin ashi de 3m o con grafico de 5m. Es muy posible que una entrada vaya mucho mas lejos de 10p hacia la proxima zona. Si por ejemplo una posicion de micro trading de 1 contrato abierta en la 1. Zona se encuentra con perdida entonces en la segunda se abre en lugar de 2 contratos solamente 1.

El numero de contratos puede ser aumentados segun el capital que cada uno disponga. De esta manera se puede practicar un Scale in/out bastante profitable.

Por efecto de la documentacion diaria ni aumento de contratos o micro trading sera considerado. Suerte y respetar las reglas.