

Fenix - Trailing stop inteligente

Este documento refleja uno de los posibles estudios realizados para encontrar la mejor manera de aplicar el trailing stop sin que los retrocesos me hagan salir de la operación, o al menos minimizando esta posibilidad. Protegiendo la operación en situaciones de grandes velas y velas convencionales, con el objetivo de actualizar el robot **Fenix** como un administrador de seguridad ante operaciones establecidas.

Plataforma: **Metatrader**

MasterWhite

Oberá (Misiones)

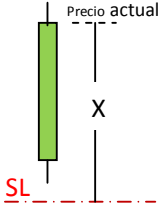
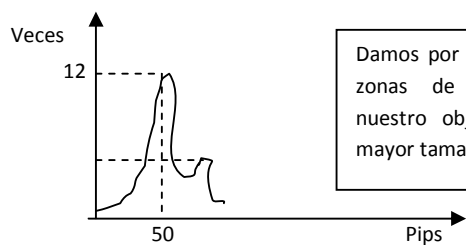
Argentina

Herramienta: 3 Trailing Stop

1) Trailing Stop de Grandes velas

El trailing stop en las grandes velas es muy importante ya que estas velas tienen un valor en pips muy importante. Son producidas por noticias fundamentales, por ende puede ocurrir que luego de su desarrollo, haya un retroceso, corrección o una continuidad, por ello tener una estrategia de trailing stop exclusivo para este tipo de velas es importante para obtener la mayor cantidad de pips.

Situación inicial

 <p>Obs: <i>Damos por aceptada la posición del SL que se define en otras instancias.</i></p>	<p>Definimos como situación inicial:</p> <ul style="list-style-type: none">• Una vela de importante tamaño en pips• Un SL (Stop Loss) posicionado por debajo del mínimo de la vela• Una distancia de disparo llamada "X" <p>Escenario 1: <u>Disparo:</u> cuando X sea igual o mayor que 50 Pips ($X \geq 50$ pips) <u>Destino:</u> Puntos destinos A 70%, B 50% o C 30%</p> <p>Observaciones: Disparo se refiere a mover el SL. Destino es la posición final a la que llevaremos el SL. El valor de 50 pips es orientativo, ya que el valor real se deberá calcular para cada par, realizando una revisión de la cantidad de veces que aparece un determinado tamaño de vela (promedio)</p> <div data-bbox="584 1606 1274 1848"><p>Damos por hecho de que existen zonas de congestión y que nuestro objetivo es la vela de mayor tamaño promedio.</p></div>
--	---

Punto destino A 70%

Lo definimos como un posible valor de destino para re-posicionar nuestro SL. En este caso nuestro primer punto destino es el 70 % del valor de la vela actual. Esto significa que deberíamos mover el SL a dicho valor. Esta es la situación de máxima.

SL corregido	Siguiente vela A1	Siguiente Vela A2
<p>Diagrama de una vela verde. Una línea horizontal roja etiquetada como 'SL' está situada a 70% del precio actual (indicado por una línea punteada). Una línea punteada superior indica el 'Precio actual'.</p>	<p>Diagrama de una vela verde que continúa la tendencia al alza. Una línea horizontal roja etiquetada como 'SL' está situada a 70% del precio actual de la vela anterior.</p>	<p>Diagrama de una vela verde que se vuelve bajista. Una línea horizontal roja etiquetada como 'SL' está situada a 70% del precio actual de la vela anterior.</p>
<p>SL corregido</p> <p>Al llegar la vela al valor de 50 pips (disparo), el sistema mueve el SL al 70 % de la vela para proteger ese profit maximizando el beneficio.</p>	<p>Siguiente vela A1</p> <p>Lo que puede ocurrir al cierre es que la siguiente vela mantiene la tendencia.</p>	<p>Siguiente Vela A2</p> <p>La otra posibilidad es que la siguiente vela sea bajista, hay grandes posibilidades de salir por SL. Es una desventaja ante un pequeño retroceso, pero garantiza el profit.</p>

Punto destino B 50%

Lo definimos como un posible valor de destino para re-posicionar nuestro SL. En este caso nuestro primer punto destino es el 50 % del valor de la vela actual. Esto significa que deberíamos mover el SL a dicho valor. Esta es la situación de intermedia.

SL corregido	Siguiente vela A1	Siguiente Vela A2
<p>Diagrama de una vela verde. Una línea horizontal roja etiquetada como 'SL' está situada a 50% del precio actual (indicado por una línea punteada).</p>	<p>Diagrama de una vela verde que continúa la tendencia al alza. Una línea horizontal roja etiquetada como 'SL' está situada a 50% del precio actual de la vela anterior.</p>	<p>Diagrama de una vela verde que se vuelve bajista. Una línea horizontal roja etiquetada como 'SL' está situada a 50% del precio actual de la vela anterior.</p>
<p>SL corregido</p> <p>Al llegar la vela al valor de 50 pips (disparo), el sistema mueve el SL al 50 % de la vela para proteger ese profit permitiendo soportar pequeños retrocesos.</p>	<p>Siguiente vela A1</p> <p>Lo que puede ocurrir al cierre es que la siguiente vela mantiene la tendencia.</p>	<p>Siguiente Vela A2</p> <p>La otra posibilidad es que la siguiente vela sea bajista, hay menos posibilidades de salir por SL. Es una ventaja ante un pequeño retroceso.</p>

Punto destino C 30%

Lo definimos como un posible valor de destino para re-posicionar nuestro SL. En este caso nuestro primer punto destino es el 30 % del valor de la vela actual. Esto significa que deberíamos mover el SL a dicho valor. Esta es la situación de mínima.

SL corregido	Siguiente vela A1	Siguiente Vela A2
<p>Diagrama de una vela verde. Una línea horizontal roja etiquetada como 'SL' está situada a 30% del precio actual (indicado por una línea punteada).</p>	<p>Diagrama de una vela verde que continúa la tendencia al alza. Una línea horizontal roja etiquetada como 'SL' está situada a 30% del precio actual de la vela anterior.</p>	<p>Diagrama de una vela verde que se vuelve bajista. Una línea horizontal roja etiquetada como 'SL' está situada a 30% del precio actual de la vela anterior.</p>

SL corregido	Siguiente vela A1	Siguiente Vela A2
Al llegar la vela al valor de 30 pips (disparo), el sistema mueve el SL al 50 % de la vela para proteger ese profit maximizando el beneficio.	Lo que puede ocurrir al cierre es que la siguiente vela mantiene la tendencia.	La otra posibilidad es que la siguiente vela sea bajista, hay grandes posibilidades de salir por SL. Es una gran ventaja ante un pequeño retroceso.

Otras alternativas posibles de definir.

- El cierre automatizado ante el retroceso de un % determinado
- El cierre automatizado ante un retroceso.

Opción a	Opción b	Opción ?
No ha sido considerada al ser similar a las situaciones 70 50 30 %	Es una posibilidad válida, con la desventaja que deja afuera la capacidad de absorber pequeños retrocesos o correcciones	

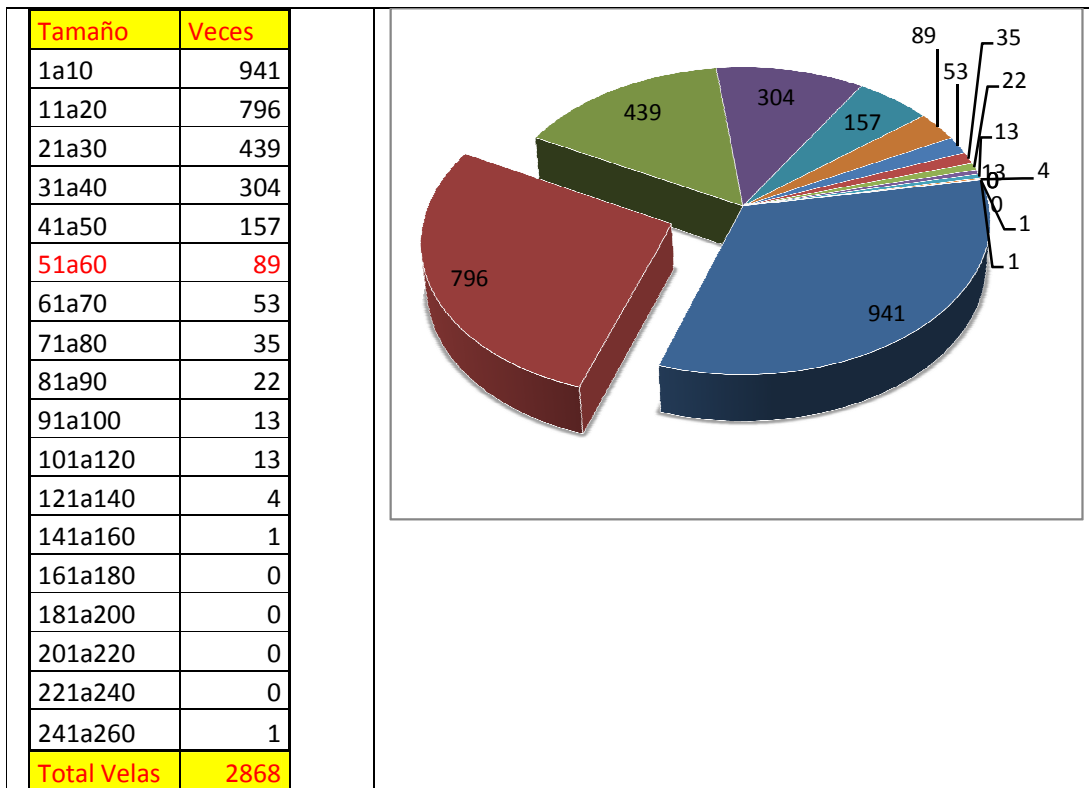
Estudio del Pip de disparo

Como he formulado al principio de este documento un valor referencial de 50 pip, como el punto de disparo, me puse a investigar a ver si podía lograr algún tipo de gráfica que me determine ese punto.

Por ello, he tomado las últimas 2868 velas a partir del viernes 04 de diciembre del 2009 hacia atrás para realizar un análisis. Para ello diseñe un sencillo programa en Metaquotes que me diga el tamaño del cuerpo de cada vela (excluyendo las sombras) y me genere un archivo con dicho tamaño en pip. Luego a ese listado lo sometí a un conteo para determinar la cantidad de veces que aparecen "rangos de velas". Esto es cuantas velas cuyo valor sea entre 11 y 20 pips hay, etc. El resultado ha sido:

Par analizado: **GBPAUD**

TimeFrame: **60M**



Bueno se observa algo obvio, las velas de mayor tamaño son las que aparecen menos y las de menor tamaño las que más aparecen, a tal punto que la mayor vela ha sido de 224 pips.

La verdad que mi criterio inicial de análisis no ha podido ser fundamentado con este estudio, ya que no refleja lo buscado, no obstante considero muy interesante ver que la cantidad de velas entre **51y60** pips ha sido de: **89**

He sistema ha encontrado 89 velas de ese tamaño en el rango estudiado, esto es en 2868 hs (porque son velas de 1H) hay 89 velas de este tamaño.

Por otro lado la cantidad de velas "importantes" si consideramos este punto, como de partida es de: 231 velas que representan el 8 % del total de las muestras.

Visto esto en pips es la friolera de: **16.610 pips**

Lo que en su máxima expresión, esto significa que operando con un robot (situación ideal, esto es todas las velas detectadas), lograríamos proteger el 70 % de esas velas menos algún factor de error, ello implicaría como MAXIMO proteger **11.627 pips**

Claro que hay que aclarar que esta es solamente una situación teórica de máxima, ya que en la realidad seria menos probable lograrlo, ya que el comportamiento de las velas es en alguna manera aleatorio.

Featured:

Queda pendiente estudiar, de que tamaño ha sido la vela consecutiva a la que aparece en el rango de 51y60 pips, ya que puede ser motivo de un detector de señal de fundamentales ya disparados.

Pendiente:

Queda pendiente luego de armar un robot es verificar los resultados obtenidos partiendo de las premisas:

- X = 50 Pips
- Zonas de movimiento al 70%, 50 % y 30 %

2) Trailing Stop de velas convencionales

En Desarrollo

3) Situación para break even automático

En Desarrollo

4) Definición de Variables

En Desarrollo

5) Fórmulas

En Desarrollo

Autor:



MasterWhite
Rubén Dieminger
Informático
Mat.Prof 036
Programador y Analista de Sistemas de Información
Blog: AnalizandoForex.blogspot.com
Grupo: TraderForex (yahoo)