

GRID TRADING

TRADING NO BINARIO III

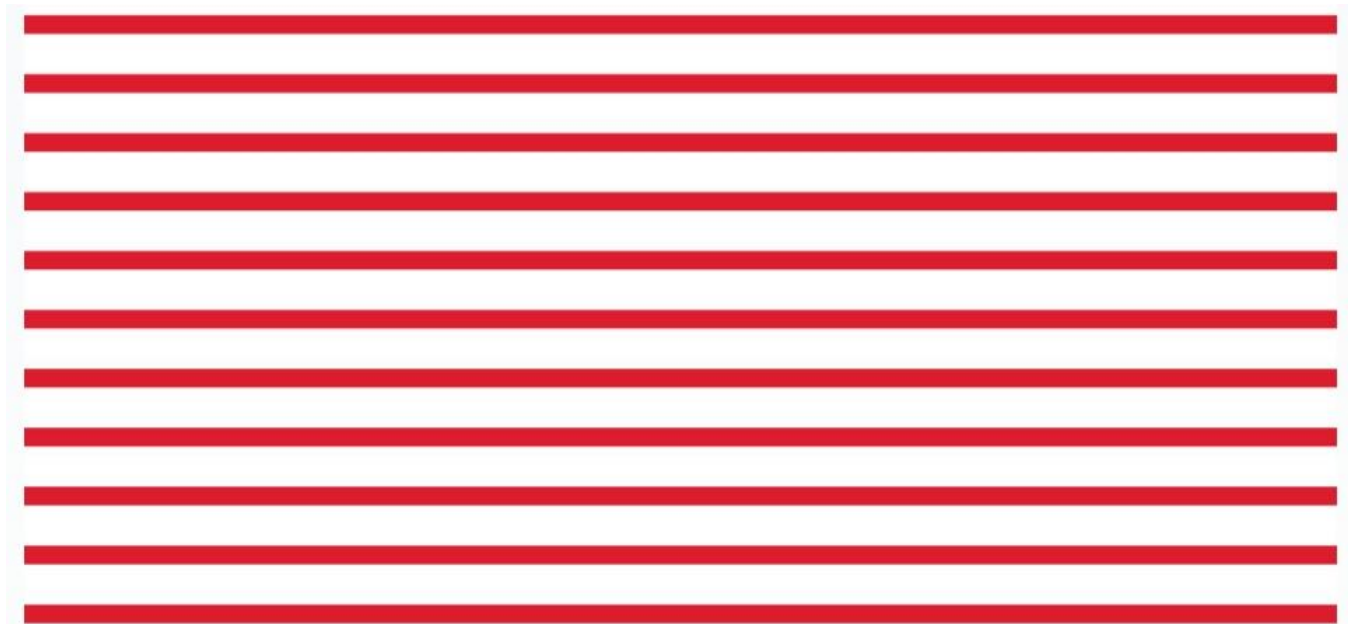
sábado, 25 de marzo de 2023

En 2020 hice una serie de 2 artículos sobre trading no binario. También hice un vídeo: <https://youtu.be/ipU1k8vUJz0>

Básicamente, el trading no binario es un trading continuo en el que variamos el número de contratos de la posición, así que nunca estamos “dentro” o “fuera” de forma binaria sino que la posición es constante y solo cambia el número de contratos. Estar fuera sería como estar dentro con cero contratos.

En aquel momento utilicé un modelo de Robert Carver para añadir y quitar contratos en función de la separación entre dos medias y la volatilidad. Si quiere todos los detalles de esa aproximación los puede ver en el vídeo.

Hoy quiero aproximar el trading no binario desde una perspectiva diferente. Se llama Grid Trading, y consiste en añadir y quitar contratos en función de unos niveles de precio preestablecidos, como si fuera una rejilla (grid en inglés).

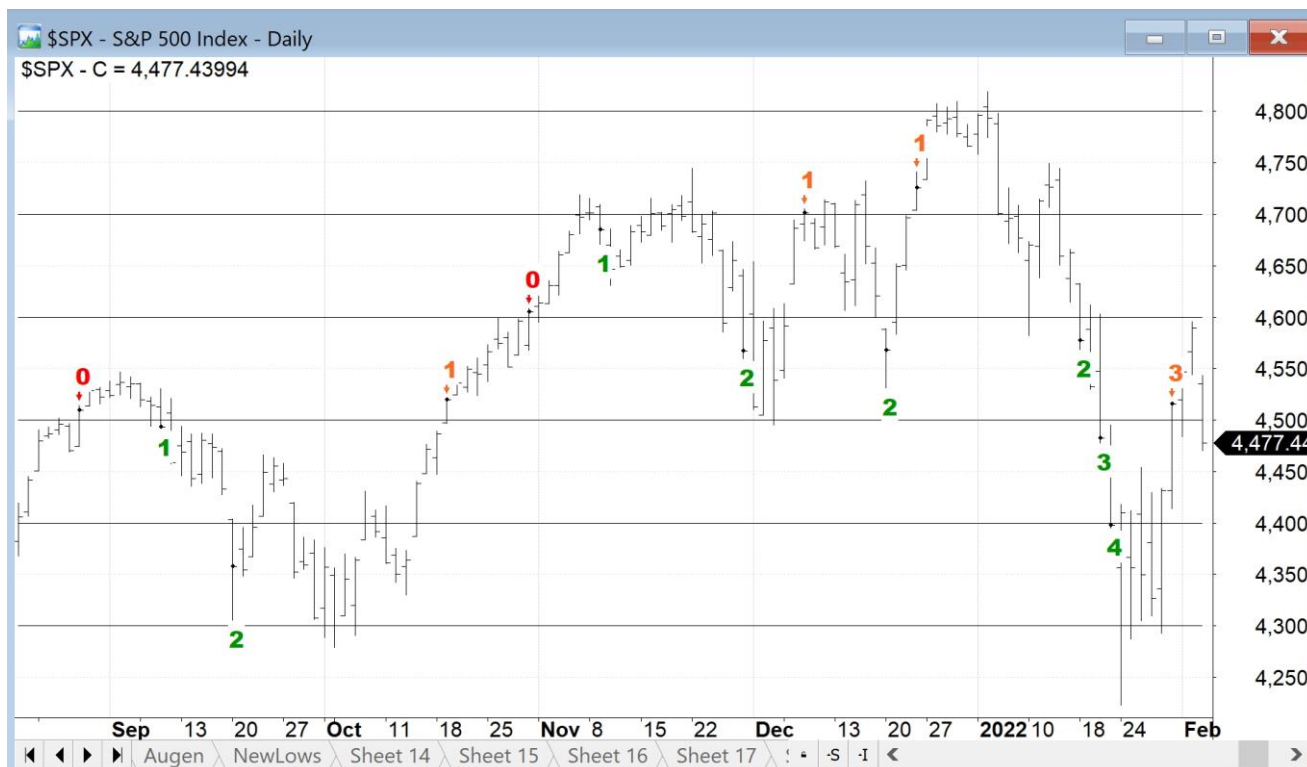


Para entenderlo lo mejor es un ejemplo. Debajo vemos el índice SP500 en gráfico diario. Empezando por la izquierda vemos un número cero. Ese es el comienzo para este caso en concreto; no hay posiciones.

Vamos a definir los niveles como separados por 100 puntos del SP500, así que el nivel justo por debajo del precio se corresponde con los 4500 puntos, más abajo tendríamos los 4400 puntos, los 4300 puntos y así... y por arriba lo mismo; es decir, tenemos una rejilla de niveles que coinciden con los múltiplos de 100 del SP500.

Vamos de izquierda a derecha por el gráfico. Al perder el primer nivel (4500) por debajo del inicio hacemos la primera compra, etiquetada con un 1. Al perder el nivel 4400 añadimos un contrato y etiquetamos con un 2. Como se puede ver, las compras siempre son al cierre.

Siempre se recuerda el último nivel que ha generado una operación (p.e. 4400) y se necesita superar el nivel siguiente para cambiar de sentido. Por eso, cuando se supera el nivel 4500 se reduce un contrato (de 2 a 1).



Prohibida su distribución. La inversión en bolsa tiene riesgo. Utilice siempre Stop-Loss. Onda4 no se responsabiliza de las operaciones de sus seguidores. Onda4 puede utilizar este material en ofertas y/o promociones en su web.

El último nivel en memoria ahora es 4500, así que al llegar a 4600 hacemos una venta (al cierre) y como solo nos quedaba un contrato pues quedamos fuera de mercado y lo marcamos con un 0 de color rojo. En este momento ya no hay posiciones y volvemos a empezar, así que al perder el primer nivel (4700) hacemos la primera compra, que se marca como un 1 verde. Tenga en cuenta que si se empieza de cero no se recuerda el nivel anterior, así que no le parezca extraño que se pueda hacer una compra más arriba que la última venta en este caso en concreto. Una vez que se pone en marcha la rutina ya solamente vamos a comprar a precios más bajos y vender a precios más altos. Todas las operaciones van a ser al precio del cierre.

La segunda compra se hace al perder el nivel 4600. Al superar el 4700 se reduce un contrato. De nuevo se pierde 4600 donde añadimos hasta 2 y se supera 4700 donde reducimos hasta 1. Se puede apreciar que este zigzag del SP500 ha salido muy rentable.

El último nivel recordado es 4700 con 1 contrato, así que al perder 4600 añadimos un segundo contrato. Las caídas continúan y se pierde el nivel 4500, así que se añade otro contrato y estamos con 3. De nuevo, las caídas continúan, así que se añade otro contrato al perder el 4400 y ahora estamos con 4.

El último nivel es 4400, así que al superar el 4500 al cierre reducimos un contrato, para quedarnos con 3 y en esta parte termina la parte visible del gráfico.

Ahora vamos a ver qué ha pasado al nivel de precios y operaciones sobre el SP500. Mi ejemplo es sobre el índice SPX que no se puede operar directamente, así que le voy a poner un multiplicador de 100 (el que tienen las opciones, para ver los puntos que se hubieran generado con esta estrategia y ese multiplicador).

La primera entrada en este ejemplo es el 9 de septiembre de 2021, a un precio de 4493.28. Posteriormente, se añade un segundo contrato el 20 de septiembre a 4357.73. Esto puede verse como una sola posición con dos contratos y precio medio de 4425.505.

El 19 de octubre se reduce un contrato (1 naranja en el gráfico), con un precio 4519.63, así que la ganancia de esta operación es $(4519.63 - 4425.505) \times 100 = \9412.50 .



Posteriormente, el 29 de octubre se cierra el contrato restante (0 rojo), al precio de 4605.38 y con una ganancia de $(4605.38 - 4425.505) \times 100 = \17987.50 . Así, a través del precio medio se van calculando las ganancias y pérdidas cuando se piramida en las posiciones. Esto es un resumen de la primera parte hasta que se queda con cero contratos:

Fecha	Ctos	Precio	PrecMed	gan pts	gan\$
09-sep-21	1	4493.28			
20-sep-21	2	4357.73	4425.505		
19-oct-21	1	4519.63		94.125	9,412.50
29-oct-21	0	4605.38		179.875	17,987.50
					27,400.00

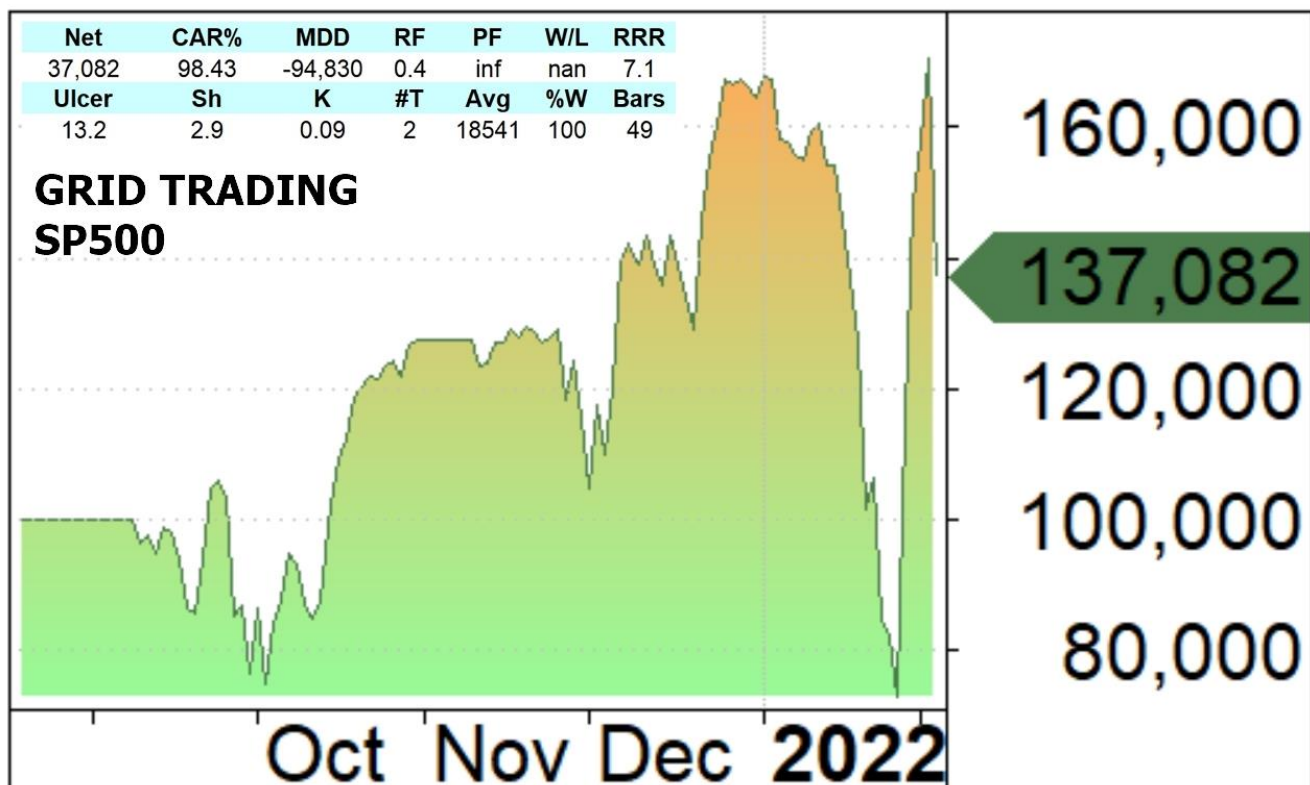
Afortunadamente, esto lo calcula Amibroker y lo refleja como ScaleIn/ScaleOut en el reporte, donde la primera variable es "añadir" y la segunda es "reducir".

Ticker	Trade	Entry	Exit	% change	Profit	Shares	Pos. value	Cum. profit	# bars	Profit/bar	MAE/MFE	Scale In/Out
\$SPX	Long	09/09/2021 4425.505	29/10/2021 4562.505	3.10%	27400.00 309.57%	1	4425.50	27400.00	37	740.54	-4.77% 2.49%	1/1
\$SPX	Open Long	09/11/2021 4513.713	03/02/2022 4562.479	1.08%	9682.06 35.49%	3	13541.14	37082.06	61	158.72	-9.87% 2.85%	5/3

Vemos que el primer conjunto de operaciones consiste en añadir una vez y reducir otra vez (1/1). En el segundo conjunto de operaciones se añade cinco veces y se reduce en tres ocasiones (5/3).

El resultado total de la porción de gráfico de ejemplo es lo que vemos debajo. Lo que interesa es el resultado final (+37K) y no el porcentaje de aciertos, que es del 100% por la propia metodología de solamente comprar a un nivel más bajo y solamente vender a un nivel más alto.

[CONTINUARÁ...]



Prohibida su distribución. La inversión en bolsa tiene riesgo. Utilice siempre Stop-Loss. Onda4 no se responsabiliza de las operaciones de sus seguidores. Onda4 puede utilizar este material en ofertas y/o promociones en su web.

230325