

Tabla de Contenidos

	Pág.
INTRODUCCIÓN	13
PARTE I: TEORIA	17
1. HIPÓTESIS DE LOS MERCADOS	19
1.1. LA HIPÓTESIS DE LOS MERCADOS EFICIENTES	20
1.2. HIPÓTESIS DE LA INEFICIENCIA DE LOS MERCADOS.....	21
2. LA UTILIDAD DE UN SISTEMA DE TRADING	23
2.1. ¿QUÉ ES UNA ESTRATEGIA DE TRADING?.....	23
2.2. ¿QUÉ ES UN SISTEMA MECÁNICO DE TRADING?	24
2.3. GENERALIDADES ACERCA DE LAS REGLAS DE TRADING.	25
2.4. ¿POR QUÉ UTILIZAR SISTEMAS MECÁNICOS DE TRADING PARA PREDECIR LA RENTABILIDAD DE UN ACTIVO FINANCIERO?	26
3. EL APRENDIZ DE BRUJO	29
3.1. AUTO-DISCIPLINA.....	30
<i>¿Qué es la auto-disciplina?</i>	31
<i>¿Qué es lo que se decide?</i>	31
<i>La actitud responsable</i>	32
3.2. AUTO CONTROL EMOCIONAL.	34
<i>Definir la pérdida potencial</i>	35
<i>Aceptar la pérdida potencial</i>	37
<i>Identificando las creencias irracionales</i>	40
<i>Reprogramando los Patrones Obsoletos</i>	44
PARTE II: ESTRATEGIAS	49
4. SISTEMA SCANVIX APLICADO A ACCIONES AMERICANAS ... 51	
4.1. CONCEPTOS PRELIMINARES AL SISTEMA SCANVIX	51
<i>Volatilidad</i>	51
<i>El índice de volatilidad VIX</i>	52
<i>Ventajas de usar el VIX</i>	53
<i>Utilizando la potencia del VIX a nuestro favor</i>	54
4.2. METODOLOGÍA PARA EL SISTEMA SCANVIX ACCIONES USA.....	55
<i>Entrada a mercado:</i>	55
<i>Salida de mercado:</i>	55
4.3. EJECUCIÓN DEL SCANVIX ACCIONES.....	56

5. SISTEMA VIXBRSI EN LOS FUTUROS E-MINI NASDAQ Y E-MINI S&P	63
5.1. EJECUCIÓN DEL VIXBRSI EN EL E-MINI NASDAQ 100	63
<i>Entrada a mercado en largo</i>	63
<i>Entrada a mercado en corto</i>	64
<i>Salida de mercado</i>	64
<i>Informe de Backtesting</i>	66
5.2. EJECUCIÓN DEL VIXBRSI EN EL E-MINI S&P 500	72
<i>Entrada a mercado</i>	72
<i>Entrada a mercado en largo</i>	72
<i>Entrada a mercado en corto</i>	72
<i>Salida de mercado</i>	73
<i>Informe de Backtesting</i>	73
6. SISTEMA INTRADIARIO CANAL R APLICADO AL FUTURO DEL BUND	79
6.1. METODOLOGÍA PARA EL SISTEMA BUND INTRADÍA CANAL R 5MIN	80
<i>Entrada a mercado</i>	81
<i>Salida de mercado</i>	82
6.2. EJECUCIÓN DEL SISTEMA BUND INTRADÍA CANAL R 5MIN LARGO.....	84
6.3. EJECUCIÓN DEL SISTEMA BUND INTRADÍA CANAL R 5MIN CORTO.....	89
7. SISTEMA DIARIO BOLLRSI FUTURO EUROSTOXX 50	95
7.1. METODOLOGÍA PARA EL SISTEMA BOLLRSI FUTURO EUROSTOXX 50.....	95
<i>Entrada a mercado</i>	95
<i>Salida de mercado</i>	96
7.2. EJECUCIÓN DEL SISTEMA BOLLRSI FUTURO EUROSTOXX 50	97
8. SISTEMA DIARIO BOLLRSI EN EL FUTURO MINI IBEX	105
8.1. METODOLOGÍA PARA EL SISTEMA BOLLRSI FUTURO MINI - IBEX	105
<i>Entrada a mercado</i>	105
<i>Salida de mercado</i>	106
8.2. EJECUCIÓN DEL SISTEMA BOLLRSI FUTURO FUTURO MINI - IBEX.....	107
9. SISTEMA DIARIO CANAL R APLICADO AL FUTURO DEL IBEX	113
9.1. METODOLOGÍA PARA EL SISTEMA CANAL R APLICADO AL FUTURO DEL IBEX	113
<i>Entrada a mercado</i>	114
<i>Salida de mercado</i>	114
9.2. EJECUCIÓN DEL SISTEMA CANAL R EN EL FUTURO DEL IBEX DIARIO.....	116
PARTE III: HERRAMIENTAS Y PROGRAMACION	121
10. CONOCIENDO LA POTENCIA Y AMIGABILIDAD DE MULTICHARTS.....	123

10.1. ASPECTOS TÉCNICOS PREVIOS	124
10.2. QUOTE MANAGER	125
<i>Añadiendo un nuevo instrumento al Quote Manager</i>	127
10.3. MULTICHARTS AREA DE TRABAJO	135
<i>Accediendo a la plataforma Multicharts</i>	135
<i>Añadiendo una estrategia de trading a un gráfico</i>	143
11. REGLAS BÁSICAS DE PROGRAMACIÓN EN POWER LANGUAGE	147
11.1. LA INTERFEZ DE POWER LANGUAGE EDITOR.....	147
11.2. PROGRAMANDO UNA ESTRATEGIA BÁSICA CON POWERLANGUAGE	152
12. CREANDO UN PORTFOLIO DE SISTEMAS	171
12.1. CONOCIENDO LA POTENCIA DEL PORTFOLIO BACKTESTER	171
12.2. AÑADIENDO INSTRUMENTOS Y SISTEMAS A UN PORTFOLIO	172
12.3. REALIZANDO UN BACKTESTING DEL SISTEMA	184
12.4. OPTIMIZANDO LOS PARÁMETROS DEL SISTEMA.....	186
12.5. CREACIÓN DE UN PORTFOLIO DE SISTEMAS	193
13. PROGRAMANDO SUS PROPIAS IDEAS DE TRADING	199
REFERENCIAS	203
ANEXOS	205
ANEXO 1. CÓDIGO FUENTE SISTEMA SCAN VIX ACCIONES USA	207
ANEXO 2. CÓDIGO FUENTE SISTEMA VIXBRSI PARA EL E-MINI NASDAQ 100	209
ANEXO 3. CÓDIGO FUENTE SISTEMA VIXBRSI PARA EL E-MINI S&P 500...211	
ANEXO 4. CÓDIGO FUENTE SISTEMA BUND INTRADÍA CANAL R 5MIN LARGO	213
ANEXO 5. CÓDIGO FUENTE SISTEMA BUND INTRADÍA CANAL R 5MIN CORTO	215
ANEXO 6. CÓDIGO FUENTE SISTEMA DIARIO BOLLRSI FUTURO EUROSTOXX 50	217
ANEXO 7. SISTEMA DIARIO BOLLRSI EN EL FUTURO MINI IBEX (LARGO) ..219	
ANEXO 8. SISTEMA DIARIO BOLLRSI EN EL FUTURO MINI IBEX (CORTO) ..221	
ANEXO 9. SISTEMA DIARIO CANAL R APLICADO AL FUTURO DEL IBEX	223