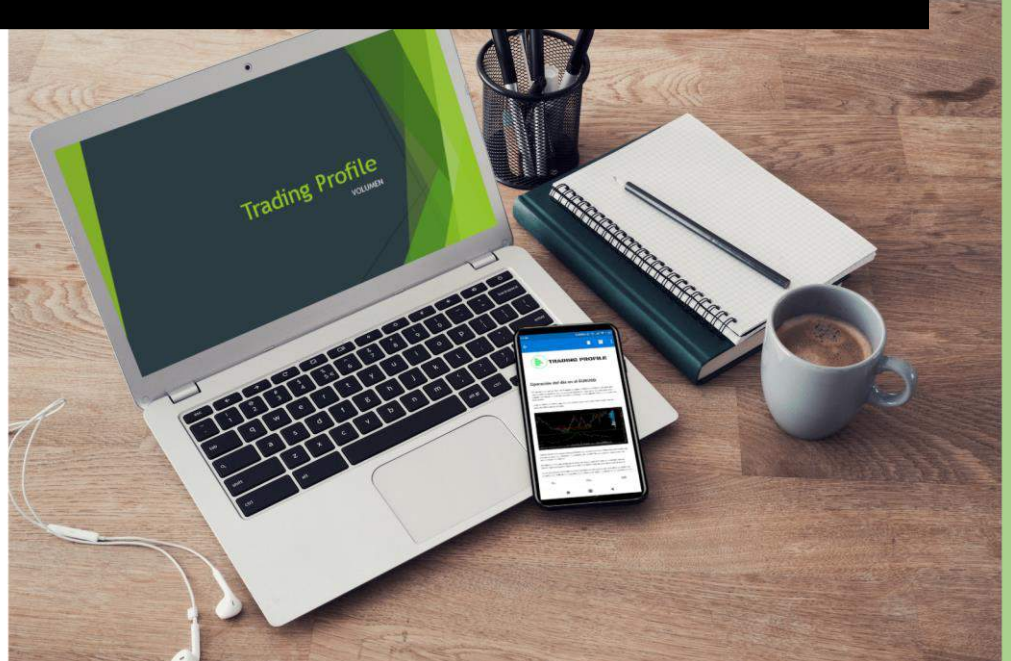




**TRADING  
PROFILE**

# INTRODUCCIÓN AL TRADING PROFESIONAL



RAÚL GONZÁLEZ



@zekelin

---

## *SI ESTÁS LEYENDO ESTO...*

---

SIGNIFICA QUE ESTÁS DISPUESTO A CONVERTIRTE EN UN MEJOR TRADER, O VIENES DE INTENTAR HACER TRADING CON EL ANÁLISIS TÉCNICO DEL TRADER MINORISTA QUE SE ENCUENTRA POR INTERNET Y DESEAS DAR EL SALTO AL TRADING MÁS PROFESIONAL...

.  
. .  
.

AL TRADING DE VERDAD. UN TRADING ORGANIZADO Y OBJETIVO.

EN CUALQUIER CASO, **ENHORABUENA**, QUE ESTÉS AQUÍ YA DEMUESTRA TU IMPLICACIÓN CONTIGO MISMO PARA MEJORAR.

Y DECIRTE QUE... VAS POR EL BUEN CAMINO 😊

---

## *Curso de Introducción: Trading Profesional*

---

1. Qué son los Mercados financieros. Qué es un activo
2. Qué es un bróker y tipos de Brokers.
3. Tipos de Trading
4. Empezando a operar en los Mercados Financieros.
5. Tipos de Órdenes y oferta y demanda
6. La verdad sobre el Análisis Técnico Retail
7. Herramientas de Trading Profesional.
  - Basarnos en datos objetivos: oferta, demanda, compras, ventas, número de órdenes (volumen).
8. Volumen y Volumen profile
9. Flujo de órdenes
10. Libro de órdenes
11. Estrategia de Trading
12. Backtest
13. Gestión del Trade
14. Gestión del Riesgo
15. Psicología.

**¿Sigues haciendo Trading sin saber a qué resultados atenerte?**

**¿Sin saber cuánto puedes ganar o cuanto puedes perder?**

**¿Sin entender por qué entras al Mercado o sin saber si esa técnica que estás utilizando funciona en el largo plazo?**

---

*Los Traders que han llegado a alcanzar la consistencia solo tienen un único secreto: tener un plan definido y objetivo*

---

Esta guía de iniciación es una manera de que empieces a entender cómo funciona el Trading real y con fundamento. Lo único objetivo que hay en el Trading son las compras, las ventas, el volumen y equilibrio entre estas, que harán subir o bajar el precio.

---

## MERCADOS FINANCIEROS

---

Un mercado financiero está compuesto por distintos **activos financieros**, donde los participantes de este mercado (**compradores y vendedores**) intercambian dichos activos en función de la oferta y la demanda disponible, fijando así el precio de ese activo.

Un mercado financiero funciona en función de la **oferta y la demanda** disponible. Es decir, si alguien quiere comprar un activo a un precio determinado, solo podrá hacerlo si hay otra persona dispuesta a vender ese activo a ese precio determinado.

La función principal de un mercado financiero es la de poner en contacto a compradores y vendedores.

**Ejemplo de un Mercado Financiero:** el mercado FOREX (mercado de divisas)

---

## ACTIVO FINANCIERO

---

Al contrario que los activos tangibles (un coche o una casa, por ejemplo), los activos financieros no suelen tener un valor físico. El comprador de un activo financiero **posee un derecho sobre ese activo**.

**Ejemplo de activo financiero:** Euro/Dólar (EURUSD, activo que forma parte del mercado financiero FOREX)

---

## BROKER VS DEALER

---

Un bróker es una entidad cuya función es **poner en contacto a un comprador de un activo, con un vendedor de ese activo**, llevándose una comisión de esa operación por su servicio.

Una cuestión muy importante y que todo el mundo debe entender antes de empezar a operar en cualquier mercado, es la diferencia entre Broker y Dealer.

Hay muchísima gente que lleva ya tiempo operando y haciendo trading sin saber muy bien qué diferencia hay entre estos dos conceptos, y es vital conocerla.

Un Broker saca al trader (comprador o vendedor) al mercado REAL, donde intercambia su orden de compra por una de venta al precio dictado por el trader, o viceversa. Es decir, hace de mero intermediario entre el Trader y el mercado.

Un Dealer, o también llamado Broker Dealer, actúa como contrapartida al trader. Es decir, este tipo de Broker tiene su propio mercado interno, al que el trader entra cuando lanza su orden de compra o venta y es este Broker el que aporta la liquidez, y te hace de contrapartida.

Para que todo el mundo lo entienda, **un Dealer, actúa como una casa de apuestas**, si tú ganas tu operación o inversión, él pierde esa cantidad. Si tu pierdes, él gana.

Por este motivo es muy importante entender que en esta situación se produce un **conflicto de intereses** entre trader y Broker Dealer.

Por este motivo, es importante saber, antes de abrirte una cuenta en un bróker, si este es un Broker puro (intermediario en el mercado real) o un Broker Dealer (tu contrapartida).

---

## *TIPOS DE TRADING*

---

El trading es una actividad de especulación sobre el precio de un activo financiero.

Se trata de comprar un activo, para luego venderlo a un valor más alto; o de vender un activo, para comprarlo después a un precio más bajo y obtener beneficios con esta diferencia de precios.

Existen varios tipos de Trading, pero de manera general podemos encontrar 2 variantes bien diferenciadas.

Trading discrecional y trading sistemático.

- **Trading discrecional:** es un trading en el que compras o vendes en función de tu lectura y análisis personal del mercado en ese preciso momento, y en base a elementos subjetivos.

Este es el trading más complicado de realizar, y se necesitan amplios conocimientos del mercado, así como, muchos años de experiencia analizando activos financieros.

Es un trading del que depende mucho la psicología. Necesitas saber controlar tus emociones en todo momento y todos los días que operes. Por este motivo, desgasta mucho mentalmente y a la mínima, podemos caer presos de alguna emoción que nos haga lamentar nuestros resultados.

- **Trading mecánico:** es el trading que casi todo trader profesional realiza. Se basa en unas reglas o premisas previamente estudiadas y definidas (estrategia de trading) para tomar tus decisiones de trading.

En este tipo de trading se suele buscar casi siempre lo mismo: un escenario concreto, un patrón en el gráfico, unas condiciones de mercado concretas y previamente definidas; para tomar la decisión de comprar o vender.

Una vez abierta la operación, la gestión de la misma también está previamente definida y estudiada. Sabiendo en todo momento en donde tenemos que cerrar la operación y cuál será la posible pérdida/ganancia.

**En el trading mecánico influyen mucho menos las emociones**, al tener un plan que seguir en todo momento (nuestra estrategia de trading).

Personalmente, **siempre recomiendo empezar con este tipo de trading**. Pues un trading puramente discrecional es sumamente complicado y conlleva un desgaste mental y emocional importante.

---

## *EMPEZANDO A OPERAR EN LOS MERCADOS FINANCIEROS (TRADING)*

---

Llegamos al primer punto vital que debes entender sí o sí, si quieres hacer Trading.

Es de vital importancia que entiendas como funciona una **transacción** en cualquier mercado financiero.

Como hemos dicho, un mercado financiero tiene como objetivo poner en contacto a compradores con vendedores.

¿Cómo los compradores y vendedores llegan a un acuerdo en un Mercado Financiero?  
A través de órdenes de compra o venta.

Y existen, de manera general, **dos tipos de órdenes** que compradores y vendedores pueden poner en el Mercado.

- Orden limitada de compra o venta
- Orden a Mercado de compra o venta

---

## TIPOS DE ÓRDENES Y OFERTA Y DEMANDA

---

Un mercado financiero se rige por la ley de la oferta y la demanda.

Para entender el concepto de oferta y demanda disponible, debemos entender el tipo de orden limitada. **Las órdenes limitadas harán de oferta y demanda.**

- Las **órdenes limitadas** son las que coloca el trader a un precio determinado que él decida.
- Mientras que las **órdenes a mercado**, se ejecutan al instante, al precio que esté en ese momento ese activo **consumiendo una orden limitada**.

Es importante este dato, las órdenes de compra a mercado, se ejecutan consumiendo una orden de venta limitada. Y las órdenes de venta a mercado, se ejecutan consumiendo una orden de compra limitada.

**\*\*\*Ejemplo:** *el precio del activo se encuentra en este momento en 1,18\$.*

*El Trader Pepito decide que él quiere vender a un precio de 1,20\$, por lo que pone una orden de venta limitada al precio 1,20\$, confiando que el precio subirá hasta ahí y entonces venderá su activo a otro comprador.*

*El precio va subiendo hasta llegar a 1,20\$ y el Trader Juanito está en ese momento operando y decide comprar en ese mismo momento al precio actual, es decir, manda una orden de compra a mercado.*

*Estas dos órdenes se cruzan y Juanito ha comprado a Pepito el activo en cuestión al precio de 1,20\$. Se ha realizado una transacción.*

Es decir, **las órdenes a mercado solamente se cruzan con las órdenes limitadas.**

Por lo tanto, las órdenes limitadas son la oferta y demanda disponible en ese momento, mientras que las órdenes a mercado van consumiendo esta oferta o demanda, haciendo que el precio suba o baje.

- **Órdenes limitadas de venta:** OFERTA disponible
- **Órdenes limitadas de compra:** DEMANDA disponible
- **Órdenes a mercado de compra:** compra directamente al precio que esté ese momento el activo, consumiendo una orden limitada de venta (consumiendo OFERTA)
- **Órdenes a mercado de venta:** vende directamente al precio que esté en ese momento el activo, consumiendo una orden limitada de compra (consumiendo DEMANDA)



Por lo que las compras y ventas a mercado serán las que hagan subir o bajar el precio de un activo.

- Si las compras a mercado son las suficientes para agotar la oferta, el precio irá subiendo.
- Si las ventas a mercado son las suficientes para agotar la demanda, el precio irá bajando.





---

*Podemos decir que los compradores agresivos (a mercado) son los que hacen subir y bajar el precio. Mientras que los compradores pasivos (limitadas) son los que proveen la liquidez (oferta y demanda).*

---

Por esto **siempre es importante fijarse en el Volumen en trading**, para medir la fuerza (cantidad de compras) de los compradores agresivos y medir la fuerza (cantidad de ventas a mercado) de los vendedores agresivos.

Además de medir las compras y ventas a mercado que entran, también **es importante medir cuanta demanda y oferta hay disponible** en ese momento.

Si la demanda es pequeña, pocas ventas harán bajar el precio. Y si la oferta es pequeña, pocas compras pueden hacer subir el precio.

De manera resumida, a la hora de hacer Trading, **es importante analizar tanto el número de compras y ventas que están entrando, como la fortaleza de la oferta o la demanda en ese momento.**

¿Cómo podemos ver esto? Con los indicadores de Volumen, Volumen Profile y flujo de órdenes que veremos más adelante.

Con la combinación de estos, junto con la acción del precio, podemos identificar que bando está más fuerte: compradores o vendedores.

Esto y solo esto es lo que importa realmente y lo único que hace que el precio de un activo suba o baje.

---

## LA VERDAD DEL ANÁLISIS TÉCNICO

---

Por esto es tan importante fijarnos en la verdadera naturaleza del mercado: **OFERTA, DEMANDA, COMPRAS, VENTAS Y EL VOLUMEN** de estas.

Esto es lo único que hará moverse el precio.

**¿Cuál es el problema con el análisis técnico que se suele enseñar a todos los Traders retails que empiezan?**

Que casi ninguna de esas técnicas se basa en cómo funciona realmente un Mercado financiero.

Con análisis técnico retail, me refiero a cosas como:

- Ondas de Elliot
- Formación de ciertas figuras en un gráfico
- Reacción del precio a una media móvil
- Indicadores basados en el precio pasado
- Retrocesos de Fibonacci

Pongamos el ejemplo del, muy usado entre Traders retails, **retroceso de Fibonacci al 61.8% del impulso anterior.**

La sucesión o serie de Fibonacci hace referencia a la secuencia ordenada de números descrita por Leonardo de Pisa, matemático italiano del siglo XIII.

En Trading, se utilizan estos números para marcar soportes/resistencias en ellos.

Por ejemplo, el precio ha realizado un impulso alcista, y ahora se encuentra retrocediendo. Obtendremos un soporte y un posible nivel de compra en el 61.8% del retroceso del impulso anterior.



La primera pregunta que me hago es **¿por qué tiene que hacer de soporte del precio, en un Mercado Financiero hoy en día, un número de una sucesión matemática creada en el Siglo XIII?**

Otra cosa más acertada sería, analizar si en ese nivel del 61.8% la demanda está fuerte, qué es lo que realmente hace de soporte al precio (mucho demanda que logre frenar las ventas a mercado), y una vez el precio llegue ahí, analizar las ventas y compras a mercado para determinar si el precio seguirá cayendo o puede rebotar desde ese punto.

Basándonos en esto, tendríamos una decisión de compra más lógica y razonada según el funcionamiento real de un Mercado Financiero.

Pero comprar en el retroceso de Fibonacci 61,8% solo porque es un número de una sucesión matemática de hace siglos, no tiene lógica ni fundamento ninguno.

Lo más probable que pase en este tipo de técnicas del Trader retail (como comprar en el 61,8% de Fibonacci) es que otro montón de traders retails que han aprendido las mismas técnicas, compren a la vez, y hagan lo mismo.

De hecho, podrás observar como el precio puede llegar a detenerse por unos instantes en este nivel del 61,8% de Fibonacci, debido a la cantidad de traders pequeños que han comprado ahí. Pero, ¿has medido y comprobado cuantas veces es realmente un rebote, y cuantas el precio simplemente se detiene para después seguir cayendo?

Siempre digo que **en el Trading hay que verificar las cosas** antes de ponerlas en práctica, y no creérselas con fe ciega, pues de ello depende tu dinero.

No estoy diciendo que no puedas hacer dinero operando los niveles 61,8% de Fibonacci, pues para hacer dinero en el Trading, intervienen muchísimas más cosas que simplemente la entrada de tu operación.

Como veremos más adelante, la gestión de la operación una vez abierta, y la gestión del riesgo que hagas, son una parte fundamental para tus resultados.

Pero quiero que entiendas, que **comprar en el 61,8% de Fibonacci**, simplemente porque es un número de la sucesión de Fibonacci, **es una decisión que no está basada en cómo funciona un Mercado ni el movimiento del precio.**

**Verifica y comprueba siempre antes de poner en práctica.**

Te aseguro que ningún Trader Institucional (los que mueven el precio) utiliza ninguna de estas técnicas.

La historia de siempre, el pezqueñin contra los tiburones. **Y los tiburones tienen hambre...**

Y una pregunta que te lanzo, ¿no sería más lógico aprender a captar la entrada de estos grandes Traders que mueven el precio, a través del volumen, y sumarnos a su favor?

El Trader Profesional siempre va a basarse en **algo que nunca miente: los números**, cantidad de oferta, de demanda y fuerza de compradores y vendedores.

Datos concretos y objetivos para ver si la demanda o la oferta están fuerte, y medir si con el volumen de compra o venta pueden hacer subir o bajar el precio.

Es en estos números objetivos, en lo que basan sus estrategias de trading, y sus decisiones de comprar o vender.

---

## *HERRAMIENTAS DE TRADING PROFESIONAL*

---

Y ¿cómo el Trader Profesional, ve y analiza estos números? Con las herramientas diseñadas para ello.

Estas son una serie de indicadores que nos marcan el volumen consumido en cierto periodo de tiempo o en cierto precio determinado (ojo a esto), la cantidad de compras y ventas a mercado que se están realizando, y en ciertos mercados, también ver la oferta y la demanda disponible en los distintos precios.

Cualquiera de estos indicadores utilizados para marcar las zonas importantes para el precio, junto con la acción misma del precio y la reacción a estas zonas, es lo único que necesita.

No necesitas nada más para construir una estrategia o método de trading, con lógica y fundamento, que funcione.

Todo lo demás es humo, o indicadores basados en el precio pasado que poco o nada tienen que ver con el verdadero movimiento del precio en el momento actual.

---

## *LA IMPORTANCIA DEL VOLUMEN*

---

¿Por qué es tan importante el Volumen?

**El mercado se basa en transacciones;** la transacción que realiza un comprador con un vendedor.

Normalmente una **transacción** es el cruce de una orden a mercado con una orden limitada.

El volumen es el indicador que nos dice cuántas transacciones se han realizado en un periodo de tiempo (Volumen) o en un precio determinado (Volumen Profile).

Aquí entra en juego una relación importante en el mundo del trading: **la relación esfuerzo/beneficio.**

El volumen es importante en el trading, porque no es lo mismo:

1. Atravesar un precio donde había muy poca resistencia (poca oferta), y esta subida se ha efectuado con muy pocas compras a mercado (**muy poco esfuerzo**).
2. Que atravesar un nivel donde había una gran oferta, y se han tenido que emplear muchas compras a mercado (**mucho esfuerzo**).

A posteriori, ese nivel, de volver a ser retestado, será mucho más importante en el segundo caso.

Por esto **el volumen es indicativo de importancia** a la hora de realizar un movimiento.

Una subida del precio que se ha hecho con muy pocas compras a mercado (poco volumen), puede indicar que los traders detrás de esas compras no poseen mucho poder de capital, o que en esos niveles no había mucho interés de negociar (no eran niveles importantes = poca oferta puesta en ese nivel).

Sin embargo, si una subida se realiza con mucho volumen, consumiendo una gran demanda es posible que grandes traders estén detrás de ese movimiento, y, por lo tanto, hay grandes posibilidades de que esa subida sea defendida por estos grandes traders en un futuro retroceso, si lo hubiera.

---

## VOLUMEN Y VOLUMEN PROFILE

---

Hay dos maneras de ver el Volumen negociado en un gráfico de precios.

**Indicador de volumen vertical:** es el indicador de volumen clásico. El volumen generado **en un tiempo determinado** que nosotros podemos configurar.

Por ejemplo, configuramos nuestro gráfico de precios de un activo en temporalidad de 15 minutos.

En este caso veremos que cada barra (vela) de precios será de 15 minutos de duración, y por lo tanto el indicador de volumen vertical nos estará indicando cuanto volumen se ha negociado en esa barra (15 minutos).



Por otro lado, tenemos el **indicador de volumen horizontal**: que se encarga de indicarnos cuánto volumen se ha negociado **en un precio determinado**.

Por ejemplo, durante una bajada del precio, nos indica que en el precio 1,146 se han realizado 352 transacciones. Que en el precio 1,145 se han hecho 482 o que en el precio 1,144 se han realizado 1564 transacciones (incremento de volumen en este precio, posible nivel importante).

El indicador de volumen horizontal (Volumen Profile) es muy importante y nos sirve de gran ayuda para marcar los niveles (precios) importantes en un gráfico de precios.

Que haya un gran volumen en un nivel determinado, significa que muchos operadores han realizado en ese nivel sus transacciones (compras, ventas), por lo tanto, ese nivel volverá a ser importante en un futuro para ellos, ya que es donde han hecho sus apuestas.

---

## *FLUJO DE ÓRDENES*

---

En el indicador de volumen, solo podremos saber el total de transacciones realizadas.

Pero dentro de una barra de volumen normal no podremos distinguir si dentro de ese volumen ha habido más compras que ventas o viceversa.

Por ejemplo, el indicador de volumen nos marca que en los últimos 15 minutos se han realizado 8000 transacciones.

Como ya sabemos, hay dos tipos de transacciones:

- Compra a mercado con una venta limitada
- Venta a mercado con una compra limitada

Pero solo con el volumen, no sabemos cuántas de esas 8000 transacciones han sido compras a mercado, y cuántas han sido ventas.

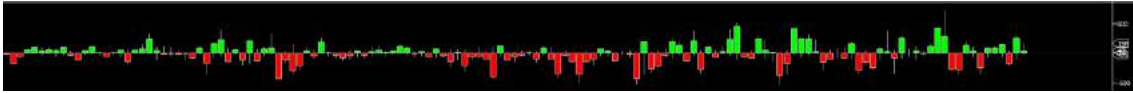
Para esto están las herramientas de flujo de órdenes.

---

## *DELTA*

---

El indicador delta es una herramienta de flujo de órdenes que nos indica **la diferencia entre las compras y las ventas a mercado** en una vela de precio determinada.



Es importante recalcar, que este indicador mide las órdenes a mercado, las que consumen órdenes limitadas, es decir las que realmente pueden hacer que el precio suba o baje.

Y remarcar también, que el delta marca la diferencia entre compras y ventas, no las compras/ventas totales realizadas en esa vela de precio.

Por esto es importante visualizar el delta junto con el volumen, para saber el impacto real de esas órdenes a mercado, y si son relevantes para que tengan una incidencia clara en el precio.

No tiene la misma importancia observar una gran diferencia a favor de las compras, en una vela dónde se ha producido muy poco volumen, que en una vela donde se ha dado un volumen muy grande.

Recuerda, el volumen suele significar importancia.




---

## LIBRO DE ÓRDENES

---

El libro de órdenes es otra herramienta que junto al flujo de órdenes y el volumen nos puede servir de gran ayuda para ver que bando (oferta o demanda) está más fuerte.

En el libro de órdenes podemos ver cuantas órdenes limitadas de venta o de compra hay colocadas en los distintos precios.



Por lo tanto, podemos ver que si, por ejemplo, hay muchísima oferta (resistencia) colocada en los niveles donde el precio se encuentra, hará falta un gran volumen de compras para hacer que el precio siga subiendo. Hará falta un gran esfuerzo.

Esto nos sirve para saber cuál es el camino con menos resistencia para que el precio se mueva. Es decir, saber si es la oferta o la demanda la que está más fuerte.

The screenshot shows a trading interface for BTC/USDT with a 1-100.0x leverage. The order book is divided into three sections: Order Book (DEMANDA), Market Trades (PRECIOS), and My Orders (OFERTA). The DEMANDA and OFERTA columns are highlighted with green boxes, and the Bid and Ask price columns are highlighted with a red box.

Order Book (DEMANDA)	Market Trades (PRECIOS)		My Orders (OFERTA)
	Bid	Ask	
3,151	9139.60	9152.80	167
1,574	9138.40	9153.21	1,600
338	9138.20	9153.60	736
789	9138.10	9153.71	1,602
800	9138.00	9154.10	1,649
309	9137.79	9154.21	1,965
2,140	9137.60	9154.50	3,984
48	9137.40	9154.60	763
144	9137.29	9154.71	157
136	9137.20	9154.80	56
528	9137.00	9155.50	320
1,654	9136.90	9155.71	200
40	9136.79	9156.10	16
46	9136.70	9156.21	219
608	9136.60	9156.30	40
48	9136.50	9156.40	80
342	9136.40	9156.50	175

---

## ESTRATEGIA DE TRADING

---

Ya entiendes cómo funciona el Mercado y porque se mueve el precio.

Bien, el siguiente paso sería montar tu estrategia de trading a seguir.

Y aquí viene el motivo que más se repite por el que la gente pierde dinero en Trading o en sus inversiones. Este motivo es **no tener un plan**.

### ¿Qué es una estrategia de Trading?

---

*Una estrategia de trading es un conjunto de normas o reglas, creadas a partir de un concepto o idea que se repite en el tiempo en algún activo, que definirán nuestras condiciones y decisiones de compra/venta.*

---

Por lo tanto, una estrategia de trading se compondrá de:

- Qué tipos de operaciones puede realizar un trader (solo compras, ventas o ambas)
- Los mercados y activos en los que participará
- Las configuraciones / set-ups / estructuras de precio específicas en las que lanzaremos las operaciones
- El contexto general del precio en el que puede operar (solo en tendencia, en rango o en ambas)
- La gestión de riesgo
- Marco temporal (¿Operaciones de horas, minutos, días, semanas o meses? ¿Largo, medio o corto plazo?)
- Las reglas en torno a las horas del día o las sesiones en las que vamos a operar
- La gestión de las operaciones una vez abiertas

Esta lista no es de ninguna manera exhaustiva.

Ciertamente hay un margen cuando se trata de cuánta discreción permite un trader en su estrategia.

Algunas estrategias de trading simplemente brindarán una guía flexible con respecto a las configuraciones de entrada y salida de la operación y el riesgo, y dejarán el resto a

discreción. Otros abarcarán mucho más que eso. El grado de discreción de nuestro sistema debería ir en función del nivel de experiencia del propio trader.

### ¿Por qué molestarse con una estrategia de trading?

---

*Un buen sistema de trading define las condiciones bajo las cuales es más probable que un trader resulte rentable y describe cómo aprovechar esas condiciones.*

---

Una estrategia de trading, una vez estudiada y diseñada, puede definir cómo se ven esas estructuras de precio, en las que se abrirán nuestras oportunidades de compra/venta, cuándo y dónde se forman, y cómo operar alrededor de ellas (así como cuándo evitarlas).

Sin una estrategia, **¿Cómo puede un trader saber si lo que está haciendo está funcionando o tiene posibilidades de ser rentable?** Se vuelve muy difícil interpretar datos significativos o hacer ajustes si el 'plan' de un trader es apostar por lo que se ve bien. O lo que él crea que se ve bien en ese momento preciso.

En pocas palabras: **es poco probable que un trader desorganizado sea un trader rentable.**

Piensa en la creación de una estrategia de trading como una forma de organizarte y tomarte en serio el trading.

No es necesario reinventar la rueda para formar la base de un buen sistema de trading.

En realidad, yo recomiendo todo lo contrario: normalmente **las cosas sencillas son las que mejor funcionan.** ¿Por qué? Por varios motivos:

- Las cosas sencillas basadas en el funcionamiento primario del Mercado (compras, ventas, volumen) funcionan siempre
- Una entrada sencilla será más fácil de ejecutar que otra muy complicada o con mil condiciones en las que fijarse
- Al igual, una gestión de la operación sencilla, será más fácil de ejecutar

Este es un error MUY cometido entre los traders novatos. Complicarse la vida mucho.

No debes tratar de encontrar la mejor estrategia de trading. Debes tratar de diseñar una estrategia de trading que se adapte a ti, a tu personalidad, a tu estilo, y, por ende, esa estrategia será rentable **EN TUS MANOS**.

---

*Tener una estrategia de trading es vital porque un trading sistemático y organizado conduce a mejores resultados.*

---

Toda estrategia o sistema de trading nace de la base de una idea o concepto.

Esta idea o concepto debe estar basada en el funcionamiento real del Mercado, que, como ya sabes, se basa en: **compras, ventas, oferta, demanda y volumen**.

A partir de aquí podemos sacar muchas ideas y podemos observar hechos, sucesos, acciones, eventos o patrones/estructuras del precio que se repiten en el tiempo.

A partir de las herramientas que hemos visto podemos detectar muchos patrones, que no entraré a profundizar ahora pues se podrían rellenar miles de páginas, que nos ofrecen posibilidades de compra/venta como, por ejemplo:

- El precio se da la vuelta en una resistencia con un gran delta comprador (compradores atrapados que deberán cerrar sus posiciones con ventas. Señal de vender)
- El precio llega a un soporte con un volumen muy alto, tras el cual podemos ver que entran muchas compras en el delta (señal de compra)
- El precio rebota en un soporte con poco volumen, para más tarde romperlo con violencia con un gran volumen y recuperación rápida del soporte (patrón de absorción de órdenes, señal de compra)

Y cómo estas señales, existen muchas más. **Son señales que tienen lógica y fundamento en el funcionamiento real de cualquier Mercado y/o activo.**

Son huellas que dejan los demás participantes del Mercado tras realizar sus operaciones. Con estas herramientas podemos valorar la importancia de esas huellas.

Por ejemplo, un trader profesional que maneja mucho volumen, sigue su propia estrategia de trading.

Él, como casi todos los traders profesionales, se dedica a hacer siempre lo mismo.

Espera que su estrategia de trading le dé la señal de compra o venta, bajo las condiciones que él definió a la hora de crear su estrategia.

Esta entrada de estos grandes traders, deja una huella en el gráfico de precios, la cual podemos detectar a través del Volumen, Volumen Profile, y/o el flujo de órdenes.

Una de las ideas, por ejemplo, podría ser analizar esta huella que dejan estos grandes traders cuando entran, y buscar una entrada a su favor.

Es decir, si un trader o grupo de traders grandes, entran comprando con mucho volumen, eso hará subir el precio. Por lo tanto, nosotros trataremos de comprar cerca de esos niveles, donde ellos también han comprado.

Una vez seleccionemos uno de los patrones o huella en el gráfico que se repita en el tiempo, es hora de estudiarlo.

---

## BACKTEST

---

El Backtest es el estudio que le haremos a ese patrón o huella que hemos detectado, para ver que rentabilidad podemos sacarle a lo largo del tiempo.

Para ello, una vez detectado un patrón, nos iremos atrás en el gráfico y buscaremos ese mismo patrón un número mínimo de veces para estudiarlo.

Con esto, conseguiremos saber, entre otras muchas cosas más:

- En qué condiciones de mercado se suele dar el patrón
- Qué punto es el más óptimo para abrir nuestra operación
- Qué punto es el más óptimo para cerrar nuestra operación
- Qué tanto por ciento de acierto/fallo tiene
- Y, por lo tanto, cuanta rentabilidad sacamos a final de mes/año

El estudio de Backtest es algo muy importante de realizar antes de operar en el mercado real.

Como siempre digo, ponerte a operar cualquier técnica, patrón o estrategia que veas o leas, sin antes comprobar que funciona o que se adapta a ti, es como ir a apostar a un casino.

Estarás poniendo tu dinero en juego sin ninguna garantía de éxito.

En el trading y la inversión: **“Nunca confíes, verifica”**.

---

## GESTIÓN DEL TRADE

---

Aquí viene una de las partes más importantes (si no la que más), junto con la gestión del riesgo, de una estrategia de trading.

Contrariamente a lo que puedas ver por internet o en redes sociales, donde solo se publican entradas perfectas o cierres de operaciones ganadoras, nunca estás viendo qué es lo que el trader ha hecho desde que abre la posición, hasta que la cierra.

La gestión de la operación es donde muchas entradas excelentes pueden acabar en una operación perdedora. O, por el contrario, una entrada mala, tardía o anticipada, puede acabar siendo una operación ganadora.

---

*En otras palabras, una de las partes más difíciles del trading es administrar la posición una vez que está abierta y antes de que llegue a tu stop loss o take profit.*

---

Una estrategia de trading no solo se compone de tener una entrada de compra o venta. Eso es solo el principio.

De hecho, la parte más importante, más que el punto donde compremos o vendemos, es **la gestión que hagamos de esta compra o venta.**

Estos son algunos factores que un buen diseño de la Gestión de las operaciones de un sistema de trading debería considerar:

- Distancia del Stop desde tu punto de entrada
- Distancia de tu Take Profit desde tu punto de entrada
- ¿Un solo Take Profit o varios? (toma de beneficios parcial, o de una sola vez)
- Número de posiciones para una misma operación
- ¿Podremos mover el Stop? ¿En contra nuestra (más riesgo) o a favor (menos riesgo)?
- ¿Colocar el Stop en Breakeven una vez alcanzado cierto recorrido a favor?  
¿Cuánto debe ser este recorrido?

Puedes hacer entradas al mercado, tardías, malas, con poco fundamento, con la tendencia en contra o en malas condiciones de mercado, y aun así salir con beneficio si la gestión es la apropiada.

Al igual que, puedes hacer la entrada perfecta, comprar justo donde el precio ha rebotado y se ha dado la vuelta al alza, y hacer un gran recorrido a tu favor, y aun así, con una mala gestión, puedes salir con pérdidas de esa operación.

A parte de la gestión de la operación, tendremos otra pata fundamental e imprescindible si queremos hacer trading: **la gestión del riesgo**.

---

## GESTIÓN DEL RIESGO

---

La otra pata, junto con la gestión de la operación, que marcará realmente nuestros resultados en el largo plazo es **la gestión del riesgo que diseñemos para nuestra estrategia de trading**.

La gestión de riesgo que diseñemos puede ser un tema muy extenso.

Como digo, una estrategia de trading no solo se compone de tener una señal de compra o de venta.

---

*Seguir la gestión del riesgo que hayamos diseñado con anterioridad, será lo que nos mantenga vivos en esta actividad en el largo plazo.*

---

No tiene mucho sentido preocuparte por las técnicas de entrada, salida, la gestión de operaciones, etc. si una sola operación o varias operaciones hacen explotar tu cuenta.

Es muy importante, marcarnos el riesgo que queremos/debemos asumir antes de abrir cualquier inversión o posición de trading.

Y, sobre todo, no improvisar sobre la marcha o una vez ya tengamos abierta la operación.

Estos son algunos factores que una gestión de Riesgo de una estrategia de trading podría considerar:

1. ¿Cuánto capital estás dispuesto a asignar a tu cuenta de trading?
2. ¿Cuál es el riesgo por operación con el que te sentirías cómodo (en términos de tanto por ciento % del saldo de tu cuenta)?
3. ¿Cuáles son tus límites de riesgo en diferentes períodos de tiempo? ¿Cuál es su límite de riesgo por operación / diario / semanal / mensual?

Como he dicho, la gestión del riesgo es un tema muy amplio en donde se pueden hacer multitud de configuraciones distintas, en función de la manera de hacer trading, el

marco temporal, duración y distancia de las operaciones, tolerancia al riesgo de cada uno...

---

## PSICOLOGÍA

---

La psicología es algo muy tratado y estudiado en el mundo del trader minorista (retail). No tanto así en el mundo del trader profesional o institucional, donde dejaron esas lecciones aprendidas hace mucho tiempo **gracias a poseer y seguir una estrategia de trading.**

Es de sabido, que invertir o hacer trading con emociones no es nada bueno.

El dinero es algo que nos puede llamar mucho la atención y despierta en nosotros sentimientos o emociones totalmente adversas a la práctica de invertir o hacer trading.

Las principales emociones que nos podemos encontrar cuando abrimos una operación son:

- **Miedo:** perder nuestra entrada al mercado por sentir miedo a la pérdida
- **Entusiasmo:** precipitarnos al entrar al mercado por imaginarnos una ganancia futura muy jugosa (también conocido como FOMO Fear Of Missing Out)
- **Esperanza:** dejar correr una operación perdedora, con la esperanza de que esta se dé la vuelta y se recupere (esta es un clásico entre la gente que empieza)
- **Confianza:** operar más de la cuenta y más de nuestros límites establecidos, porque venimos de una racha muy buena y nos sentimos con mucha confianza
- **Venganza:** operar más de la cuenta, porque venimos de una racha de operaciones perdedoras, y queremos recuperar lo perdido (otra muy común)

Estas emociones, entre otras, no harán más que dañar nuestros resultados a final de mes. Por lo que debemos aprender a controlarlas.

Como seres humanos, las emociones forman parte de nosotros, es casi inevitable.

Pero la mejor forma de mantener a raya estas emociones es **seguir un plan previamente trazado.**

Esto es, tener **nuestra estrategia de trading, diseñada y estudiada con antelación.**

---

*Tener un plan nos dará la confianza necesaria para ejecutarlo y seguirlo a pesar de lo que podamos sentir en ese momento.*

---

**Es muy importante, vital, que la estrategia sea nuestra.**



Cuando se empieza a trabajar con sistemas esto no parece demasiado relevante, y la mayoría se inclina por coger una estrategia ya hecha, de terceros o copiada de internet.

Craso error. No olvidemos que el **auténtico enemigo de nuestro trading no es el mercado si no nosotros mismos.**

Una misma estrategia será perfectamente rentable en manos de un trader, y un absoluto desastre en manos de otro.

---

*En el futuro nos resultará muy útil que la estrategia sea nuestra desde el inicio, ya que eso conlleva conocerla a fondo, lo cual fomenta la confianza en ella y la disciplina para ejecutarla.*

---

Cuando la estrategia es nuestra hay un vínculo entre el sistema y el trader, es tu estrategia, tu trabajo, tu esfuerzo, y sabes lo que el precio hará casi antes de que lo haga.

Confiamos en ella porque la hemos trabajado y eso facilita seguir las señales y reglas a raja tabla.

---

## CONCLUSIÓN

---

¡Bien hecho si has llegado hasta aquí!

Como he dicho, este es un tema muy amplio y con margen de preferencia personal. Pues como siempre digo, que la estrategia se adapte a tu personalidad y a tu estilo es de vital importancia para que esta sea rentable en tus manos.

Lo que es universal es que estar organizado en tus operaciones te convertirá en un mejor trader. De esto no hay ningún tipo de duda.

Esto debería ser más que suficiente para empezar.

Sistematizar tu trading y ser organizado marcará una diferencia muy significativa y positiva en tu forma de operar.

Feliz Trading.

Si quieres profundizar más en el diseño de Estrategias de Trading, el funcionamiento del Volumen, Volumen Profile, Flujo de Ordenes, cómo detectar al Trader Profesional o el estudio de Backtest te invito a que eches un vistazo al acceso a la comunidad [TRADING PRO](#):

<https://tradingprofile.es/curso-trading-profesional/>