

PROYECTO: 100 OPERACIONES BITACORA DE OPERACIONES AL 23 DE JUN 2012

SEMANA DEL 17 AL 20 DE JUNIO

Esta es la segunda semana del proyecto 100operaciones; un recorrido a través de 100 operaciones en los mercados financieros. Al momento de redactar esta nota se han realizado un total de 43 operaciones.

1.-Domingo 17 de junio:

Los mercados abrían el domingo con un tono optimista luego de los eventos políticos ocurridos en Grecia. La semana anterior había dejado tres operaciones abiertas en el EURUSD y el AUDUSD, previendo una continuidad en el rebote de dichos cruces, sobre todo, luego de los resultados en las elecciones Griegas. Tal como esperaba, el mercado abrió con un importante gap al alza y decidí cerrar las operaciones que habían sido abiertas durante el viernes. Previendo una corrección similar a la presentada la semana anterior. De esta forma lograba cerrar en promedio mas de 80 pips por cruce. La semana comenzaba con muy buen tono para mi operativa.

2.- Lunes 18 de junio

El día lunes comienza con un buen tono en los mercados. Sin embargo, dada la sobrecompra existente en algunos cruces, decido realizar cortos en el EURUSD y AUDUSD esperando que el gap fuese llenado parcialmente. Dichas operaciones las cierro de forma positiva.

Un activo que comenzaba a dibujar una claro patrón bajista era el Oro, hice mucho hincapié en el twitter acerca de la posible corrección del oro durante la semana. Decido entrar corto en niveles cercanos a los 1618. Coloco un stop de 10 puntos que lamentablemente es tomado durante el día. En lo que abre el mercado americano observo que el sp500 presenta una clara señal alcista y decido entrar largo en el índice. Esta operación la cierro de forma positiva teniendo poca duración en el mercado. En la tarde antes del cierre vuelvo a entrar largo en el sp500 y lo cierro de forma positiva. Dado el buen cierre en NY, continúo con mi view "Risk On" para el mercado y decido realizar dos largos en el EURUSD y AUDUSD con la intención de dejarlos correr durante el horario Asiático y Europeo. En este punto dichas operaciones eran las numero 28 y 29 respectivamente.

3.- Martes 19 de junio

El día comienza con un excelente tono "RiskOn". Cierro las operaciones largas en el eurUSD y audUSD abiertas el día anterior de forma positiva. A pesar de dicho cierre, observo que mi señal alcista sigue vigente y decido abrir nuevamente largos en el AUDUSD. Posteriormente, una vez abierto el mercado americano entro largo en el SP500 y también en el EURUSD. Cierro dichas operaciones durante la jornada y todas positivas.

En sintonía con el patrón bajista dibujado desde el inicio de semana en el Oro, decido entrar corto. Hago tres operaciones durante la sesión. Las dos primeras con un excelente resultado. La ultima la dejo colocada con la intención de dejarla correr durante la noche. Sin embargo, por alguna extraña razón decido elevar el limit y colocarlo muy cerca de mi nivel de entrada para no dejarla correr. Dada la volatilidad presentada en el Oro en las ultimas operaciones, tenía el temor que mis stops fuesen violados. Esta operación se cierra de forma positiva. Sin embargo, si la hubiese dejado correr el beneficio hubiese sido grande, ya que la caída esperada en el Oro se termino materializando con mucha mas fuerza el día miércoles en un importante "sell off" en todos los mercados. Este fue un día perfecto. Todas las operaciones cerradas fueron positivas. En este punto, la cuenta de capital se encontraba por encima de un 4% de retorno. Se habían cerrado 35 operaciones.

Operaciones 18;
19 y 21

Operaciones 22 a
29

Operaciones 30 a
35

Operaciones 36-43

4.- Miércoles 20 de junio: El peor día de operativa hasta ahora.

Cuando las cosas empiezan mal, es muy probable que se pongan peor si no se realizan correctivos. El miércoles era un día especialmente riesgoso ya que teníamos el esperado anuncio de la FED. La Reserva Federal decepciona al mercado prorrogando la operación twist por 6 meses más, pero no da pistas claras acerca de adicionales medidas de estímulo. Por otra parte, un email de Goldman Sachs dando un precio objetivo para el SP500 en 1280 convulsiona el mercado. Las ventas no tardan en llegar y todo el mercado comienza a experimentar una fuerte caída. Mis primeras operaciones fueron dos cortos en el EURUSD y AUDUSD. Esto lo hago luego de conocerse los anuncios de la FED. Estos cruces experimentaron un sell-off momentáneo el cual decidí aprovechar. Mi idea era que el dólar se apreciaría con fuerza luego de no existir señales de QE. Sin embargo, al momento, se dieron la vuelta con fuerza y me lavaron el stop colocado inicialmente. No estaban ajustados de acuerdo a la volatilidad presentada por el anuncio fundamental. A pesar de ello, la contundencia del giro me genera ahora una señal de compra, la cual sigo y realizo un stop and reverse, en este punto ya me encuentro persiguiendo al precio en un tono emocional (operaciones 38 a 42) En ese momento entro largo al mercado nuevamente en el eurUSD y el audUSD. No tardó mucho para que las operaciones estuvieran positivas y recuperar parte de la pérdida generada con la lavada anterior. Sin embargo, pasé por alto un importante nivel de resistencia que existía en el eurUSD y audUSD que en operaciones anteriores había mencionado. Había entrado largo muy cerca de dicho nivel en una muy mala relación de riesgo/retorno. Dichas resistencias funcionaron y rápidamente el mercado comienza nuevamente a caer. Hasta ese momento el mercado FX era una completa Montaña Rusa. Antes de que girara a la baja el mercado, decido entrar largo en el SP500 aprovechando el retome de la tendencia "riskOn" que al final duraría muy poco. El día transcurre y los niveles de soporte tanto en el eurUSD, audUSD como en el SP500 son alcanzados. En dicho punto he debido ejecutar una salida dinámica para proteger la cuenta de pérdidas mayores, sin embargo, atrapado en una espiral emocional negativa, golpeado por los cierres anteriores, dejo correr las ordenes hasta los stops colocados y en efecto son ejecutados. Al final y para cerrar con broche de Oro mi equivocación del día y ya muy fuera de foco de la estrategia general, decido hacer un largo (pequeño) en el Oro ya que este se encontraba en el soporte de los 1600 (en contra de mi view semanal). Sorpresa, el Oro cae con mayor fuerza y mi stop que esta vez había sido colocado con amplitud en 1570 es alcanzado. En ese momento ya había cerrado la computadora y me había ido a dar un paseo al parque, tomar algo de aire lejos de los monitores. No había sido un buen día. El mercado dio buenas oportunidades y no solo no las aproveche, sino que se convirtieron en riesgos importantes para mi cuenta al finalizar la jornada. Mi actuación fue mediocre y me deje llevar por la marea emocional del mercado, terminando persiguiendo al precio y siendo lavado dos veces en la misma jornada.

De cualquier forma active mi protocolo de control de riesgos, decidí cerrar las pantallas y no acelerar mis pérdidas en una forma de actuar que claramente no era la correcta.

Jueves y Viernes me mantuve fuera del mercado, analizando mi actuación del miércoles y generando la estrategia para la semana siguiente.

Si no se tiene el cuidado adecuado, un solo día de mercado, un solo gran error puede destruir mucho tiempo de trabajo. Y en este negocio y en la vida, el tiempo es un activo mucho mas valioso que el propio dinero.

Veamos como sigue esto la semana que viene.

Saludos.

@acardenasfx