

PROYECTO: 100 OPERACIONES

RESUMEN DE OPERACIONES AL 23 DE JUNIO

Proyecto 100 Operaciones

Cuadro de operaciones

N°	Activo	Operación	Precio E	G.C	G.R	Precio Cierre	Tiempo	Pips/ptos	Hora tweet Vzla	R. O %	R. Acum %
1	eurusd	largo	1.2655	0.50%	1.0%	1.2615	2 horas	menos 50 pips	10 de jun 5:40 pm	-0.2500	-0.2500
2	usdjpy	largo	79.53	0.50%	1.0%	79.4000	20 horas	menos 13 pips	10 de jun 7:54 pm	-0.0652	-0.3152
3	fut sp500	largo	1327.5	3%	2.0%	1322.0000	1 hora	menos 5,5 pto	11 de jun 8:04 am	-0.8248	-1.1400
4	eurusd	largo	1.2555	3%	3.0%	1.2490	1 hora	menos 65 pips	11 de jun 9:36 am	-1.9527	-3.0927
5	sp500	largo	1315.75	2%	2.0%	1308.7500	1 hora	menos 7 pto	11 de jun 12:16 pm	-0.7005	-3.7932
6	eurusd	largo	1.2501	2%	2.0%	1.2473	4 horas	menos 28 pips	11 de jun 12:18 pm	-0.5643	-4.3576
7	oro	corto	1597	2%	2.0%	1592.0000	4 horas	mas 5 pto	11 de jun 4:34 pm	1.0030	-3.3545
8	usdjpy	corto	79.4	1%	1.0%	79.5000	14 horas	menos 10 pips	11 de jun 4:55 pm	-0.1291	-3.4836
9	sp500	largo	1319	2%	2.0%	1324.5000	2 horas	mas 5,5 pto	12 de jun 2:58 pm	0.5526	-2.9310
10	Oro	largo	1310	2%	2.0%	1322.0000	16 horas	mas 12 pto	12 de jun 3:01 pm	2.3981	-0.5330
11	usdjpy	corto	79.5	2%	2.0%	79.3400	7 horas	mas 16 pips	13 de jun 8:14 am	0.4164	-0.1166
12	oro	largo	1621	2%	2.0%	1619.8000	1 hora	menos 1,2 pto	13 de jun 10:08 am	-0.2392	-0.3558
13	sp500	corto	1322	1%	1.0%	1329.0000	26 horas	menos 7 pto	13 de jun 11:30 am	-0.3497	-0.7055
14	sp500	corto	1318.25	1%	1.0%	1328.0000	24 horas	menos 9,75 pto	13 de jun 2:24 pm	-0.4913	-1.1968
15	oro	corto	1617.75	1%	2.0%	1624.0000	19 horas	menos 6,25 pto	13 de jun 2:25 pm	-0.6329	-1.8297
16	audusd	corto	0.9948	1%	1.5%	0.9975	17 horas	menos 27 pips	13 de jun 4:05 pm	-0.2752	-2.1049
17	eurusd	corto	1.2559	1%	1.5%	1.2590	17 horas	menos 31 pips	13 de jun 4:17 pm	-0.3168	-2.4217
18	eurusd	largo	1.2633	2%	1.5%	1.2740	3 horas	mas 107 pips	14 de jun 3:43 pm	2.1400	-0.2817
19	audusd	largo	1.0023	1%	1.5%	1.0123	3 horas	mas 100 pips	14 de jun 3:44 pm	0.9736	0.6919
20	oro	largo	1628.85	1%	2.0%	1620.0000	menos 1 hora	menos 8,85 pto	15 de jun 8:11 am	-0.8621	-0.1702
21	eurusd	largo	1.2657	2%	2.0%	1.2740	3 horas	mas 83 pips	15 de jun 3:31 pm	1.6145	1.4443
22	eurusd	corto	1.2617	1%	1.5%	1.2611	2 horas	mas 6 pips	18 de jun 6:35 am	0.0600	1.5043
23	audusd	corto	1.0086	2%	2.0%	1.0071	1 hora	mas 15 pips	18 de jun 6:41 am	0.1509	1.6552
24	oro	corto	1619.8	2%	3.0%	1631.0000	10 horas	menos 11.2 pto	18 de jun 7:50 am	-1.1249	0.5303
25	sp500 fut	largo	1333	2%	2.0%	1337.2500	1 hora	mas 4.25 pto	18 de jun 9:15 am	0.4233	0.9535
26	oro	corto	1617	1%	2.0%	1627.0000	3 horas	menos 10 pto	18 de jun 9:35 am	-1.9834	-1.0299
27	sp500	largo	1339	2%	2.0%	1341.0000	2 horas	mas 2 pto	18 de jun 1:30 pm	0.1983	-0.8316
28	eurusd	largo	1.2576	2%	2.0%	1.2601	6 horas	mas 25 pips	18 de jun 1:34 pm	0.4998	-0.3317
29	audusd	largo	1.0127	1%	2.0%	1.0178	18 horas	mas 51 pips	18 de jun 1:50 pm	0.5022	0.1704
30	audusd	largo	1.015	2%	2.0%	1.0178	2 horas	mas 28 pips	19 de jun 6:40 am	0.5542	0.7247
31	sp500 fut	largo	1344	2	2.5%	1351.0000	3,5 horas	mas 7 pto	19 de jun 6:42 am	0.7377	1.4624
32	eurusd	largo	1.2621	2	2.5%	1.2642	2 horas	mas 21 pips	19 de jun 6:57 am	0.4199	1.8823
33	oro	corto	1628	2	2.5%	1618.0000	2 horas	mas 10 pto	19 de jun 8:41 am	2.0010	3.8833
34	oro	corto	1626.5	1	2.0%	1618.0000	1 hora	mas 8.5 pto	19 de jun 10:30 am	0.8329	4.7162
35	oro	corto	1618	2	2.5%	1617.0000	8 horas	mas 1 pto	19 de jun 4:13 pm	0.2001	4.9163
36	eurusd	corto	1.2647	1	2.0%	1.2703	menos 1 hora	menos 56 pips	20 de jun 12:08 pm	-0.5602	4.3560
37	audusd	corto	1.0167	2	2.0%	1.0215	1 hora	menos 48 pips	20 de jun 12:20 pm	-0.9658	3.3903
38	eurusd	largo	1.2706	2	2.0%	1.2650	4 horas	menos 56 pips	20 de jun 12:35 pm	-1.1171	2.2732
39	audusd	largo	1.021	2	2.0%	1.0150	4 horas	menos 60 pips	20 de jun 12:38 pm	-1.2104	1.0627
40	eurusd	largo	1.2738	2	2.0%	1.2688	2 horas	menos 50 pips	20 de jun 12:39 pm	-1.0211	0.0417
41	sp500	largo	1353.25	1	2.0%	1345.0000	1 hora	menos 8,25 pto	20 de jun 12:43 pm	-0.4255	-0.3839
42	sp500	largo	1348	2	2.0%	1338.0000	4 horas	menos 10 pto	20 de jun 3:13 pm	-0.9958	-1.3796
43	oro	largo	1601.25	1	2.0%	1570.0000	8 horas	menos 31.25 pto	20 de jun 8:55 pm	-3.1108	-4.4904

Números de la operativa en la segunda semana:

Operaciones realizadas: 43; Operaciones cerradas: 43; Operaciones abiertas: 0

Operaciones positivas: 19 ; Operaciones Negativas: 24

Largos: 26. Cortos: 17. Activos operados: eurUSD, USDJPY, AUDUSD, oro, SP500,

Fiabilidad a la fecha: 44.19% (baja)

Profit Factor: 0.77 ptos. (muy bajo) Promedio Operaciones positivas: 0.819% Promedio operaciones negativas: -0.841%

Retorno total de las operaciones cerradas a la fecha: -4.49%

Max Drawdown: -9.4%.

Mayor serie de operaciones negativas: 8

Mayor serie de operaciones positivas: 9

Tiempo Promedio de operaciones: 6.31 horas. Operación de mayor duración: 26 horas.

Cuadro resumen por activo por operación cerrada

Activo	N ° O.	Largos	Cortos	Positivas	Negativas	Ptos/Pips Acum.	Retorno Acum.
eurUSD	12	9	3	5	7	-94	-1.048
USDJPY	3	1	2	1	2	-7	0.2221
AUDUSD	7	4	3	4	3	59	-1.048
SP500	10	8	2	4	6	-28.75	-1.8758
oro	11	4	7	5	6	-31.85	-1.279

Comentarios

Las operaciones cerradas el día miércoles 20 de junio han sido las responsables de cerrar en forma negativa los puntos acumulados para el SP500, EURUSD y Oro en la presente semana.

En un solo día de operaciones se dañó el beneficio acumulado en la semana que sumaba un 4.91%.

El "Drawdown" presentado esta semana es muy superior al de la semana pasada. El max actual es de -9.4%. Debido a este número, decidí suspender la operativa por el resto de la semana para evaluar y corregir errores. Esto forma parte de mi política de control una vez entro en una espiral de pérdidas peligrosa.

El peor rendimiento por clase de activo se encuentra en las operaciones realizadas sobre el SP500.

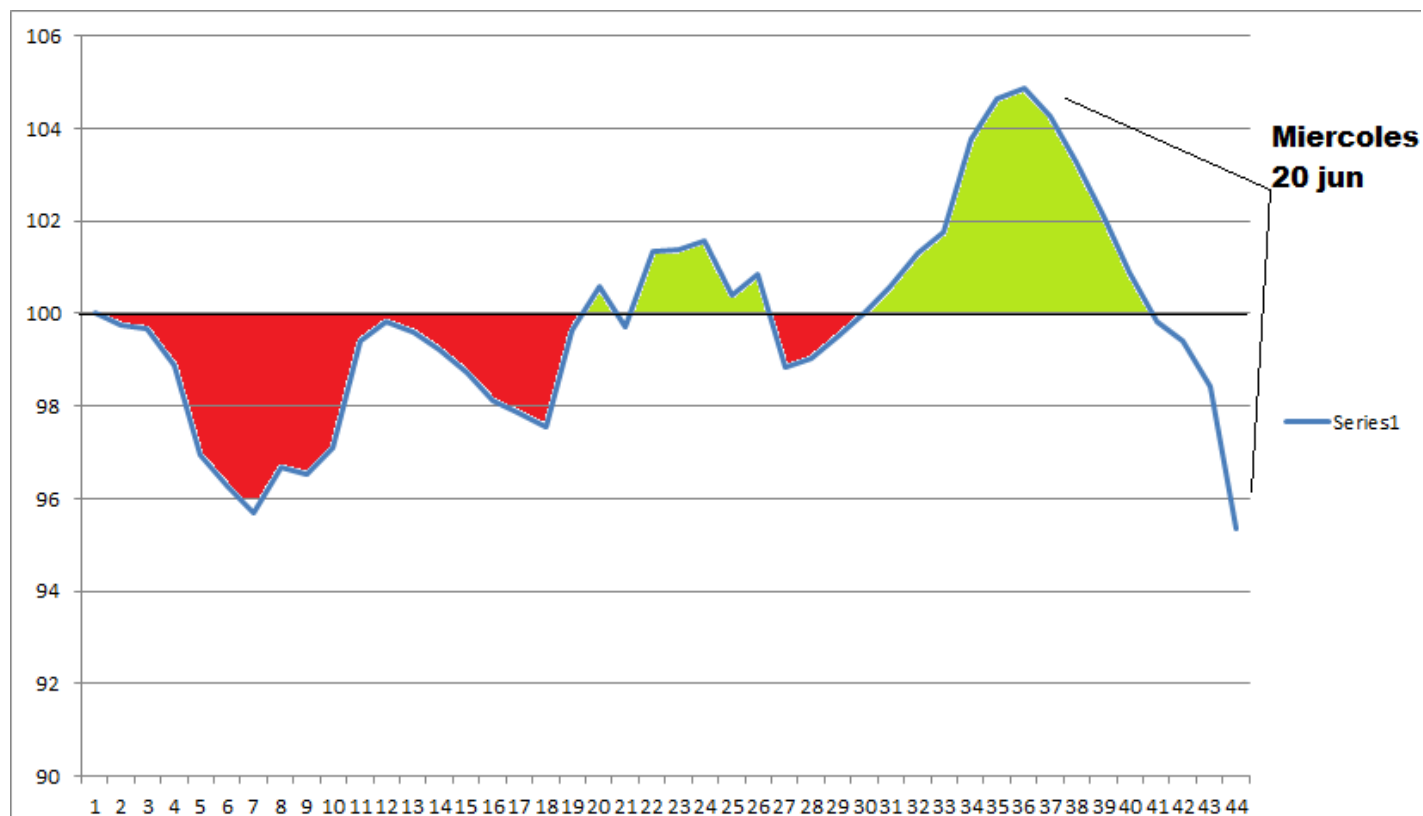
La mayor cantidad de puntos acumulados negativos se encuentra en el Oro. Esto debido a un cierre con "stop-loss" muy amplio el día jueves 21 de junio.

El retorno acumulado a la fecha de las 43 operaciones cerradas se encuentra en -4.49%

La Fiabilidad y el Profit Factor aumentaron con respecto a la semana anterior, sin embargo, siguen siendo muy bajos.

El tiempo promedio de las operaciones logró reducirse, sin embargo, debe continuar hasta llegar a niveles inferiores a 5 horas promedio.

Las operaciones cerradas el día miércoles 20 de junio elevaron considerablemente el promedio de operaciones negativas. Estas salidas fueron realizadas a través de stops amplios. Pude haber realizado una salida dinámica que permitiera gestionar de mejor forma la espiral de pérdidas presentadas ese día.

Curva de Capital en % (43 operaciones cerradas)**Análisis y Conclusiones:**

La curva de capital muestra como la semana pasada los números llegaron a estar verdes con un retorno acumulado superior al 4.8%. Sin embargo, el día miércoles de la presente semana, todos los buenos ratios se vieron impactados por otra importante racha perdedora. Fueron 8 operaciones consecutivas negativas cerradas y con un apalancamiento relativamente elevado. Esto provoco un importante "Drawdown" en la cuenta de capital que termino cerrando la semana en -4.49%. La caída generada durante dicho día fue del 9.4%. Ha sido una caída muy fuerte que disparo todas las alarmas en mi gestión de riesgo. Suspendí las operaciones durante el día jueves y viernes y ahora me dispongo a continuar operando a un ritmo mucho mas lento y con un criterio mas conservador hasta estabilizar la cuenta de capital. Es necesario que eleve los números de fiabilidad y definitivamente posicionar el "profit factor" por encima de 1.

Nadie nos obliga a entrar al mercado, cuando las cosas no van bien, lo peor que podemos hacer es acelerar nuestra caída, ya sea haciendo mas operaciones o incrementando el apalancamiento. Desde mi perspectiva, y es algo que me ha costado aprender (luego de muuuchos golpes), cuando entramos en una racha negativa, debemos relajarnos, hacer una pausa, analizar, bajar el ritmo de exposición, bajar el ritmo de operativa, bajar el apalancamiento utilizado, y comenzar a operar de nuevo hasta poco a poco estabilizar los números. Lo importante es cortar las perdidas. Después, con el tiempo, hay que remontar. Si al final eres disciplinado, cumples un conjunto de reglas que han probado funcionar en el pasado, y te mantienes enfocado, los números verdes mas temprano que tarde llegaran. Pero por ahora, ese no es el foco. El foco es no perder más.. Cuando aprendemos a perder, sin duda alguna, empezamos a ganar de verdad. Y esa es parte de la clave de todo este asunto. Seguimos con mas la semana que viene, gracias por acompañarme. El trading no es una carrera de velocidad, es mucho más de resistencia. Saludos.

@acardenasfx