

Como hacer un Backtesting aplicado al Mercado Forex

Te gustaría ser un perdedor constante y hacer trizas tus cuentas de la manera mas fácil? Si tu respuesta es NO (espero que así sea, aunque hay muchos que les encanta perder dinero) entonces te invito a que en los próximos 5 minutos interiorices la importancia de usar el Backtesting como arma fundamental para tu éxito operando en Forex y como sacarle el máximo provecho a la información que esta herramienta nos brinda.

Hacer un Backtesting no es más que recoger un conjunto de datos (eventos) y someterlos a la estrategia (sistema de trading) que estamos tratando de probar a fin de medir su eficiencia. Aquí la pregunta clave es: ¿Si la gran mayoría de entendidos en Forex coinciden en lo fundamental de realizar los Backtesting, por qué a pesar de las advertencias, los traders novatos y no tan novatos no lo usan como se debe?

Aquí pienso pueden haber 2 respuestas: la primera es que a muchos les cuesta hacerlo. Yo diría les cansa, les aburre, les fastidia, no entienden o simplemente no les da la gana y prefieren lanzarse a operar su estrategia en los demos e incluso en los reales. Grave error, al final esa gente siempre serán perdedores constantes. Siempre. ¿Y por qué? Yo diría que la codicia, la impaciencia e incluso el facilismo que pueden tener muchas personas en sus mentes y en su forma de entender la vida los hace aventurarse y entrar “cegados” al mercado. Luego, cuando volaron sus primeras cuentas vienen las frustraciones.

Luego hay otro grupo que si lo realiza. Lo he visto en muchos traders novatos (y muchos que tienen años ya operando), pero no lo saben hacer. Conclusión, tienen la buena intención, pero las buenas intenciones no generan pips, así que también pasan a formar parte de la gran masa de perdedores.

Ambos grupos de operadores pierden en parte también porque este negocio es demasiado Individualista (Ud cuando opera es posible que no tenga a nadie al costado que le diga que hacer y sobretodo “què no hacer”) entonces los errores y brutalidades que uno pueda cometer están a la orden del día, un motivo mas de por que fracasan tantos operadores. Tal vez con la suficiente guía al momento de usar los demos y luego en los reales (estoy seguro) millones de dólares no serian tirados al agua. Dicha “Individualidad natural al operar” hace también que aun, si Ud practicara mucho en las cuentas demos, no estará libre de cometer errores en la reales. Todos los vicios y desaciertos que Ud realice en sus demos o cuentas de simulación las repetirá en las reales (de todas maneras), por esta falta de guía o tutoría y en gran parte por su inexperiencia.

Conclusión: No hacer adecuadamente los Backtesting lo convertirá en perdedor permanente. Si Ud, intenta operar un sistema en el mercado real sin una previa verificación estadística de su desempeño, lo único que conseguirá será destrozar su propio dinero.

¿Por qué es tan importante hacer un Backtesting?

- i. Porque tendrá “alguna CERTEZA estadística” del arma que utiliza y la eficiencia de la misma, sobre el éxito al abrir y cerrar una posición.
- ii. Porque reducirá sus MIEDOS al entrar al mercado.
- iii. Porque Ud al momento de operar en Forex necesita CONFIANZA (y mucha creame), en su método, al saber que cualquier cosa puede suceder en los mercado y muchas veces en los momentos menos pensados.
- iv. Porque los operadores de Forex no somos ADIVINOS. No trate de jugar al casino con su cuenta y operar al instinto o a la corazonada. Usar un método debidamente probado es ser RESPONSABLE y es justamente esa, una cualidad básica que debe tener un trader.

Cómo elaborar un Backtesting:

Es laborioso, pero cuando Ud tenga la plantilla ya desarrollada le servirá para poder evaluar cualquier estrategia. En primer lugar debe tener (obviamente) la estrategia que desea medir. Esta debe de ser clara y contar con entradas y salidas específicas. Aquí quisiera ser claro, cuando digo específico me refiero a eliminar cualquier tipo de subjetividad y solamente entrar o salir usando sus indicadores. Otro aspecto, es que dicho método a evaluar no tenga demasiados indicadores. Tener muchos indicadores solo frenará múltiples entradas y lo llenarán de falsos ingresos al mercado porque mientras (por ejemplo) el Momentum y los estocásticos le indiquen entrada, es posible que el ADX y el MACD no o viceversa. A veces por nuestro afán de perfeccionar el método llegamos incluso a “adornarlo” de tantos indicadores que a la larga solo nos retrasarán con la toma de decisiones. Entonces simplifiquemos la operatoria y su medición.

Con un método establecido deberá elegir el par de divisa que quiera evaluar y el espacio temporal. Si Ud, solo se dedica a operar por algunas horas, entonces escoja un espacio temporal acorde a las horas en que Ud podría estar en el mercado. Medir en otros espacios de tiempo no lo descarto pero va amarrado a la disponibilidad del operador. Escoja Ud, si medirá el método en horario Americano, Europeo o Asiático. A diferencia de otros mercados Ud aquí sí tiene para escoger.

Con esto claro podrá elaborar una plantilla sencilla en Excel donde muestre el par que esta usando; el precio de entrada (según su método) y el precio de salida. Entre ambos precios (entrada y salida) aparecerán también los máximos. Es decir lo máximo ganado y lo máximo perdido. Dicha información será vital para su análisis. En principio podría separar todos los máximos ganados y agruparlos como un conjunto de eventos del cual podríamos obtener la media y su desviación estándar. ¿Qué logramos con esto?, saber con alguna certeza estadística donde se encuentra la mayor concentración de dichos máximos y esto le dará la pauta para definir mas adelante su Limit (al momento de programar su método). Por ejemplo si el 65% de la concentración de los máximos de su método se encuentra entre los valores de 90 y 70 (por decir 2 cantidades) entonces podría ser cualquier valor de esta zona el que Ud escoja para que sea su Limit a futuro. Ahora bien, Ud también podría agrandar su espectro de concentración de pip's o achicarlo y hacerle los respectivos ajustes. Lo mismo ocurre desde el lado de las pérdidas máximas. Y tendría que ser razonado de esta forma: “Cuánto podría aguantar mi método en pips para cerrar o no una posición y esta regrese a ser ganadora” (es decir descubrir el stop mas adecuado). La pregunta clave, a continuación sería: ¿Y cuantos datos debería evaluar? Personalmente, pienso que desde 200 a 400 datos; que representaría entre 3 a 5 meses aprox. Si, es trabajoso, yo lo se (nunca dije que fuera sencillo), pero si muy eficaz. Con un Backtesting bien trabajado Ud tendrá una maquina demoledora de estrategias que le permita encontrar el sistema mas idóneo para ganar consistentemente y no unas cuantas semanas o unos cuantos meses.

Para terminar recuerde que su Limit siempre debe ser mayor que su Stop. SIEMPRE. Si su método o la forma de operar que Ud tiene le hace ganar 35 pip's y Ud cuando pierde lo hace con 40 pip's entonces arriesga considerablemente su capital (sin considerar el spread y las comisiones). Otros casos son peores, ganar 5 pips y perder hasta 20 pip's, no tiene sentido ni lógica y lo mejor sería descartarlos de plano. Sin embargo, aunque parezca mentira algunos operadores que recién inician lo hacen de esa forma. Por eso, lo importante de difundir y explicar con claridad estos temas.

Bien amigos, como siempre es un gusto colaborar con un pequeño aporte. Para cualquier consulta me pueden escribir a: druizb@consultant.com éxitos y operen con responsabilidad.

Saludos desde Lima, Perú.

Daniel Arturo Ruiz Bravo