

LEY DE LOS GRANDES NÚMEROS



Y

GESTION DE RIESGO EN EL TRADING

A BOOK BY
FRANK DÍAZ



Copyright© 23 de diciembre del 2023 Profit Trading Frank Díaz.
Todos los derechos reservados. No se permite la reproducción total o parcial de este libro, ni su incorporación a un sistema informático, ni su transmisión en cualquier forma o por cualquier medio (electrónico, mecánico, fotocopia, grabación u otros) sin autorización previa y por escrito de los titulares del copyright. La infracción de dichos derechos puede constituir un delito contra la propiedad intelectual.

GESTION DE RIESGO

Para entender lo importante que es la gestión de riesgo en el trading, primero te hablaré sobre una ley matemática que le dará mas sentido a tu trading y te quitará un gran miedo que tienes a la hora de operar y esos nervios que te dan al no saber si el precio tocara tu **SL** o tu **TP**.

LEY DE LOS GRANDES NÚMEROS

Esta ley nos dice que cuando realizas muchos experimentos aleatorios, la media de los resultados tiende a acercarse al valor esperado. Esto significa que mientras más veces repitas un experimento, más los resultados promedio se parecerán a lo que deberías obtener según las probabilidades. Es una manera de explicar cómo, a largo plazo, los eventos aleatorios siguen patrones predecibles basados en la probabilidad teórica.

Te lo explicaré mas fácil.

La Ley de los Grandes Números es como una regla que nos dice que cuando hacemos algo muchas veces, el resultado promedio tiende a ser lo que esperamos.

Por ejemplo, si lanzas una moneda al aire muchas veces, aunque algunas veces salga cara y otras cruz, si sigues lanzándola muchas más veces, el número total de caras y cruces será casi igual. Esto se acerca a lo que matemáticamente esperarías: la mitad de las veces debería ser cara y la mitad cruz.

Básicamente, la Ley de los Grandes Números nos dice que cuando hacemos suficientes intentos en un experimento, el resultado promedio tiende a acercarse al resultado esperado. Es como si la probabilidad matemática se cumpliera más a medida que haces más intentos.

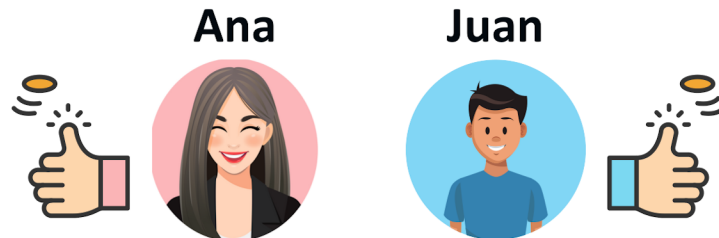


PROBABILIDADES MIENTRAS MAS LO INTENTES

INTENTOS	GANAS	PIERDES
5 VECES	20%	80%
50 VECES	40%	60%
100 VECES	50%	50%

LEY DE LOS GRANDES NÚMEROS EJEMPLO:

"Imagina a Ana y Juan, dos amigos que deciden realizar un experimento para entender la Ley de los Grandes Números. Para ello, toman una moneda y comienzan a lanzarla al aire, registrando si cae cara o sello en cada lanzamiento.



Al principio, después de lanzar la moneda solo unas pocas veces, los resultados parecen un poco caóticos: podrían obtener tres caras seguidas y luego dos sellos. Pero a medida que continúan lanzando la moneda más y más veces, algo interesante comienza a suceder.

Después de 10 lanzamientos, han obtenido 6 caras y 4 sellos, lo cual parece desigual. Sin embargo, cuando llegan a 100 lanzamientos, el número se acerca más a lo que esperarías: alrededor de 50% caras y 50% sellos. Y a medida que siguen lanzando la moneda 1000 veces, el resultado es sorprendente: casi exactamente la mitad de las veces la moneda muestra cara y la otra mitad sello.



A pesar de que en cada lanzamiento individual el resultado puede ser impredecible, la sorpresa surge cuando observan el patrón general. Aquí es donde entra en juego la Ley de los Grandes Números: cuanto más lanzan la moneda, más se acerca el número de caras y sellos a la mitad del total de lanzamientos. Esto muestra cómo, a largo plazo, la regularidad de la probabilidad se manifiesta a través del promedio de los resultados, demostrando la poderosa influencia de esta ley en los eventos aleatorios."

LEY DE LOS GRANDES NÚMEROS APLICADO AL TRADING

A medida que un trader realiza más operaciones, es más probable que los resultados se acerquen al promedio esperado.

Imagina a un trader que tiene una estrategia que le dice que, en promedio, gana el 60% de las veces y pierde el 40% restante en sus operaciones. Al principio, en un número pequeño de operaciones, los resultados pueden ser muy variables. Puede tener rachas de ganancias o pérdidas que no reflejen exactamente esas proporciones.

CORTO PLAZO

Esto no sirve para nada en la vida
eso quiere decir que un par de operaciones no
definen tu trading.

Ganaste 2 operaciones

Perdiste 5 operaciones

71% de las operaciones son perdedoras y el
29% son ganadoras estos resultados están lejos
de la estadística de mi estrategia que es de un
60% ganar y 40% perder.

Sin embargo, si este trader sigue operando muchas veces, la Ley de los Grandes Números sugiere que, a largo plazo, el porcentaje de operaciones ganadoras se acercará al 60% y el de operaciones perdedoras al 40%. Esto significa que, aunque algunas operaciones puedan tener resultados inesperados, la idea es que al hacer muchas operaciones, los resultados promedio se acerquen a las probabilidades que la estrategia sugiere.

LARGO PLAZO

Esta es la clave de tu Éxito
eso quiere decir que si tus objetivos son a largo
plazo por mas difícil o feo que se ponga el
camino en el corto plazo tu seguirás con la
vista en el objetivo ya que a largo plazo todo
sale bien.

Ganaste 60 operaciones

Perdiste 40 operaciones

Después de 100 operaciones lograste conseguir
el 60% ganar y 40% perder de tu metodología.

Los traders utilizan esta ley para comprender que a pesar de que una operación en particular pueda generar una pérdida, si siguen aplicando su estrategia con disciplina y realizan numerosas operaciones, es más probable que sus resultados generales se ajusten a las expectativas basadas en la probabilidad de su estrategia.

Con lo visto anteriormente podrás ver que si lo aplicas en tu trading y no te enfocas simplemente en un par de operaciones. y empiezas a operar de forma profesional y consistente veras que tus resultados se verán reflejados en tu cuenta a partir de unas 50 a 100 operaciones. Ya que a mas operaciones hagas permitirás que la probabilidad de tu estrategia se vea reflejada en tus resultados.

BASES DEL TRADING

60% Psicología



30% Gestión de riesgo



10% Estrategia



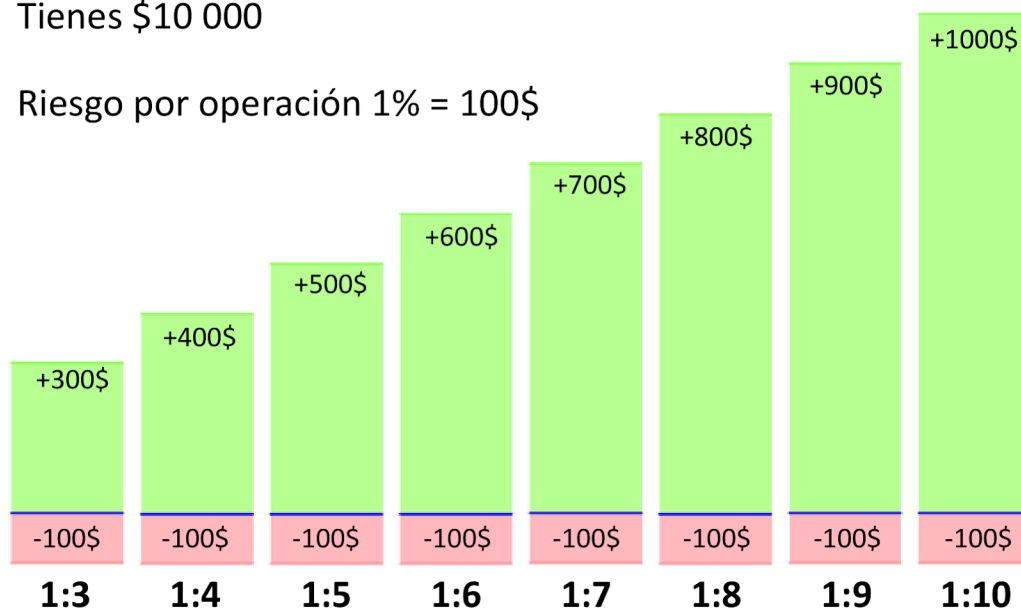
30% Gestión de riesgo



Te daré mi punto de vista y como yo veo la gestión, para mi es muy importante entender el concepto del arriesgo el 1% de mi cuenta por operación y busco ganancias de un 3%, esto es lo que muchos traders conocen como el 1:3. te mostrare como se ve esto en el grafico.

Tienes \$10 000

Riesgo por operación 1% = 100\$





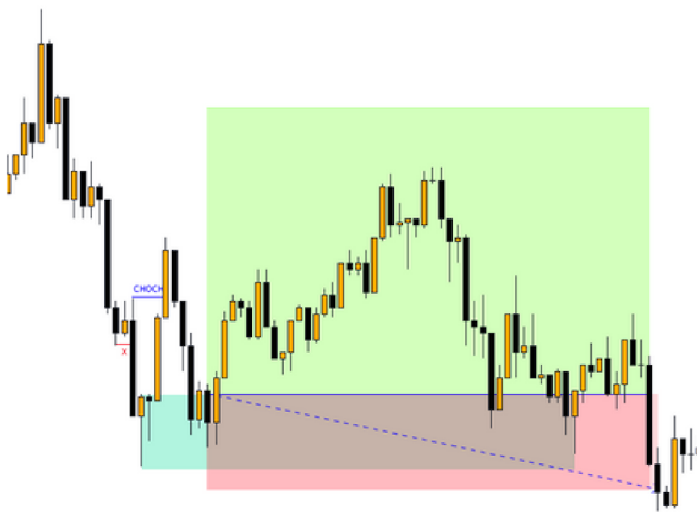
ERROR DEL NOVATO



Un par de operaciones define su trading, como están acostumbrado a ver por todos lados que el trading es fácil y es la herramienta para ganar dinero rápido, están con esa mala idea del trading y nubla su verdadero potencial por estar enfocado en resultados a corto plazo y no deja que su estrategia demuestre su rentabilidad al largo plazo,

Ejemplo:

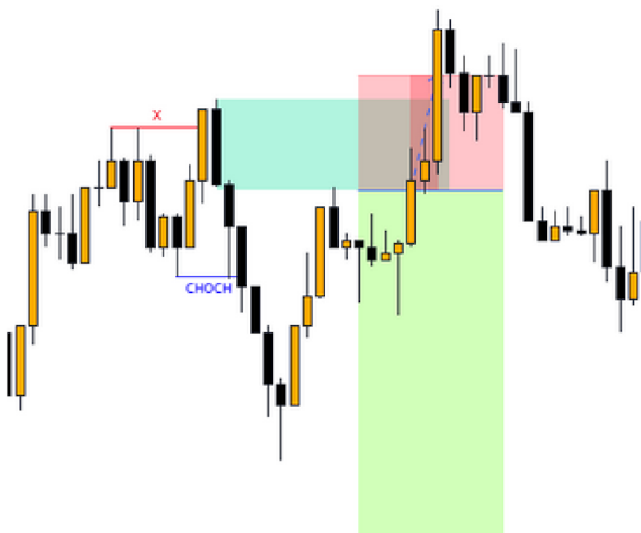
CUENTA DE 10 000\$



Stop - loss

PERDIO 1%

-100\$



Stop - loss

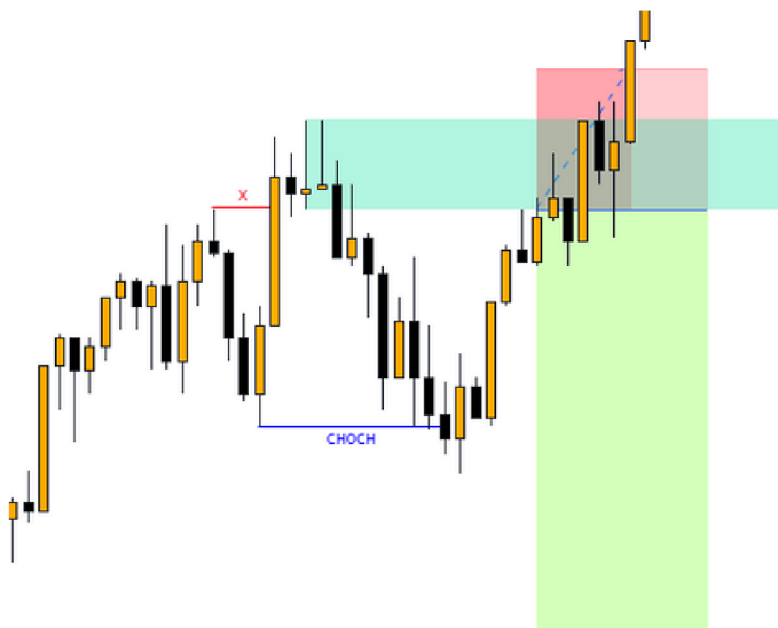
PERDIO 1%

-100\$





ERROR DEL NOVATO



Stop - loss

PERDIO 1%

-100\$ 

Trader Novato pierde un par de operaciones y entra en pánico, su trading lo define solo 2 a 3 máximo 4 operaciones, si no ganan dinero con 4 operaciones creen que no sirve una metodología y se ponen a buscar el santo grial una metodología que no pierda Stop loss.

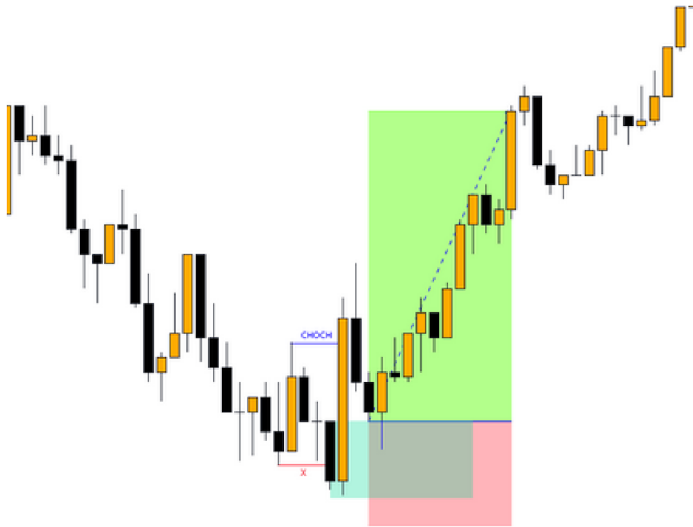
AUDUSD, buy 2.60		2023.12.05 16:44:59
0.65567 → 0.65528		-101.40
S / L:	0.65529	T / P: —
Apertura:	2023.12.05 16:40:42	Swap: 0.00
Id:	#20300874	Comisión: -5.20
AUDUSD, sell 2.40		2023.12.07 18:45:00
0.65957 → 0.65999		-100.80
S / L:	0.65999	T / P: 0.65832
Apertura:	2023.12.07 18:21:08	Swap: 0.00
Id:	#21532598	Comisión: -4.80
AUDUSD, buy 2.00		2023.12.12 19:49:44
0.65547 → 0.65495		-104.00
S / L:	0.65497	T / P: 0.65745
Apertura:	2023.12.12 19:15:16	Swap: 0.00
Id:	#23178066	Comisión: -4.00



TRADER PROFESIONAL



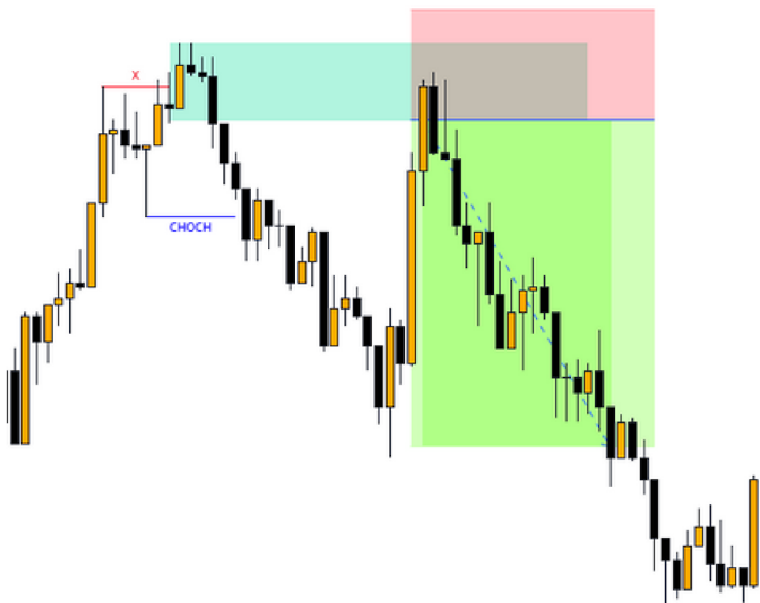
El trader profesional no se deja llevar por resultados a corto plazo, conoce su metodología y sabe que las probabilidades de perder siempre están en juego y un par de operaciones negativas son parte de su metodología, El trader profesional no pierde el enfoque ni duda de lo que esta haciendo y continua haciendo lo mismo una y otra vez hasta lograr acercarse al porcentaje de éxito de su metodología.



Take - Profit

Gano 3%

+300\$



Take - Profit

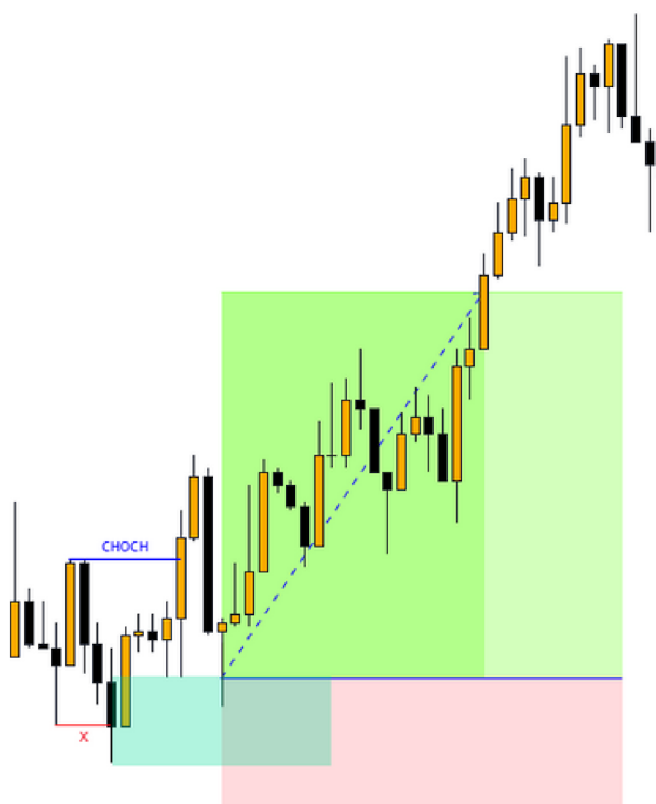
Gano 3%

+300\$





TRADER PROFESIONAL



Take - Profit

Gano 3%

+300\$



Trader profesional a medida que va usando mas su metodología empieza a ver resultados positivos en su cuenta a pesar de a veces tener operaciones perdidas la clave está en respetar tus reglas de la metodología que estás usando.

NZDUSD, buy 1.00		2023.12.13 18:00:07
0.60916 → 0.61247		331.00
S / L:	0.60814	T / P: 0.61248
Apertura:	2023.12.13 12:44:50	Swap: 0.00
Id:	#23406761	Comisión: -2.00
NZDUSD, sell 0.63		2023.12.14 15:30:49
0.62417 → 0.61892		330.75
S / L:	0.62379	T / P: 0.61892
Apertura:	2023.12.14 08:19:58	Swap: 0.00
Id:	#23898632	Comisión: -1.26
EURNZD, sell 0.70		2023.12.15 10:15:24
1.77278 → 1.76534		323.77
S / L:	1.77426	T / P: 1.76531
Apertura:	2023.12.15 08:26:06	Swap: 0.00
Id:	#24425480	Comisión: -1.40