



Módulo 3 | Gestión del Riesgo en Trading

Gonzalo Muñoz | Research XTB



Esta presentación se ofrece únicamente con fines de información general y marketing. Las opiniones, análisis u otros contenidos no constituyen asesoramiento ni recomendación de inversión. Los estudios no se han preparado de conformidad con los requisitos legales para promover la independencia de los estudios de inversión y, como tal, se consideran comunicaciones de marketing. XTB no aceptará responsabilidad por ninguna pérdida o daño, incluida, entre otras, cualquier pérdida de beneficios, que pueda surgir directa o indirectamente del uso o la confianza en dicha información.

“Tenga en cuenta que la información y los estudios basados en datos históricos o en el rendimiento no garantizan el rendimiento o los resultados futuros. El rendimiento pasado no es necesariamente indicativo de resultados futuros, y cualquier persona que actúe en función de esta información lo hace bajo su propio riesgo”.

El 77 % de las cuentas de inversores minoristas pierden dinero al operar con CFD con este proveedor. Debe considerar si comprende cómo funcionan los CFD y si puede permitirse asumir el alto riesgo de perder su dinero.



Técnicas de Gestión del Riesgo para el Scalping

1

Establecer Órdenes de Stop Loss:

Las órdenes de stop loss son una herramienta esencial para los scalpers.

2

Usar Órdenes de Take Profit:

Las órdenes de take profit son otra herramienta útil para los scalpers.

3

Implementar el Ratio Riesgo/Recompensa:

Esta técnica implica establecer un ratio de riesgo/recompensa para cada operación.

4

Hacer Scalping en Mercados Líquidos:

El scalping en mercados líquidos significa operar en mercados con altos volúmenes de negociación.

5

Evitar Eventos de Noticias:

Los eventos de noticias pueden causar movimientos significativos en los precios del mercado, haciéndolos impredecibles.



Pilares Fundamentales para una Gestión Exitosa

Riesgo por Operación

1-2%

Limitar el riesgo en cada operación protege el balance y permite sobrevivir a rachas negativas

Ratio Riesgo/
Recompensa
(R/R)

Mínimo
1:2

Con este ratio, no es necesario un alto porcentaje de aciertos para ser rentable a largo plazo.

Ajuste del
Lotaje Según
la Volatilidad
y análisis



- Alta volatilidad: Reducir el tamaño del lote para controlar el impacto de movimientos grandes.
- Baja volatilidad: Incrementar el tamaño del lote para optimizar el beneficio sin exceder el riesgo.

Diferencia entre
Pips -
Porcentajes

"Distancia"
vs "%"

Usar solo porcentajes puede generar una percepción engañosa del beneficio, exponiéndose a mayores riesgos.

33% de aciertos es suficiente para ser rentable con un ratio R/R de 1:3.

(Por cada 3 operaciones, con que 1 sea exitosa se obtendrán ganancias netas).





Ajuste del Lotaje

Cuando se opera con instrumentos financieros como Nasdaq y EURUSD, es crucial ajustar correctamente el tamaño del lote, ya que el valor del contrato y el margen requerido difieren significativamente. A continuación, explicaré el ajuste del lotaje usando los datos proporcionados.

US100 CFD ⓘ

Instrument CFD which price is based on quotations of the futures contract for NASDA...

Orden a mercado **Orden Stop/limitada**

Volumen	Valor del contrato	<u>USD</u>	Margen	CLP
1	≈ 435 802.90		≈ 2 125 246.83	

EURUSD CFD ⓘ

Euro to American Dollar

Orden a mercado **Orden Stop/limitada**

Volumen	Valor del contrato	<u>EUR</u>	Margen	CLP
1	≈ 100 000.00		≈ 511 353.15	



Para asegurarte de que no arriesgas más del 1% del capital, debes ajustar el cálculo del tamaño del lote de la siguiente manera:

Fórmula ajustada al riesgo:

$$\text{Tamaño del Lote} = \frac{\text{Riesgo Total Permitido}}{\text{Distancia Stop Loss} \times \text{Valor por Pip/Punto}}$$

- **Riesgo Total Permitido:** Es el porcentaje del capital que estás dispuesto a arriesgar (1% del capital total en este caso).
- **Distancia Stop Loss:** La distancia en pips o puntos entre el precio de entrada y el nivel de stop loss.
- **Valor por Pip/Punto:** Cuánto dinero representa un pip o punto por cada lote estándar.

Ejemplo con 1% de riesgo:

1. **Capital Total:** \$10,000.
2. **Riesgo Permitido:** \$100 (1% de \$10,000).
3. **Distancia Stop Loss:** 50 pips.
4. **Valor por Pip:** \$10 por lote estándar (para EUR/USD).

El tamaño del lote sería:

$$\text{Tamaño del Lote} = \frac{100}{50 \times 10} = 0.2 \text{ lotes estándar.}$$

US100

CFD

Instrument CFD which price is based on quotations of the futures contract for NASDAQ

Orden a mercado

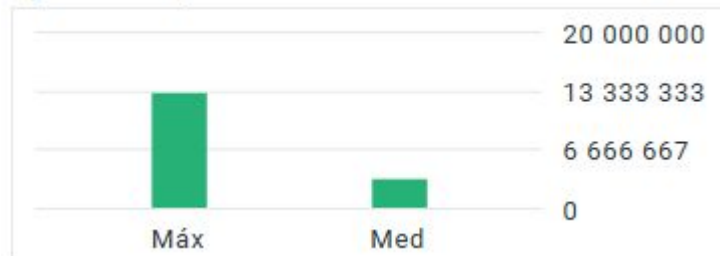
Orden Stop/limitada

Volumen	Valor del contrato	USD	Margen	CLP
1	≈ 436 347.60		≈ 2 127 903.61	
Spread	Comisión	Valor del pip	Swap diario	
20 481.20 CLP (1.05 pips)	0.00 CLP (0.00%)	19 505.90 CLP	Vender: 0.00 CLP Comprar: -100 209.40 CLP	
☒ Stop loss			Take profit ☒	
21811.39	precio		21835.39	
	Vender ☐ Comprar ☒			
-6.00	pips		18.00	
-117 035.40	CLP		351 106.20	
-0.33	%		0.98	

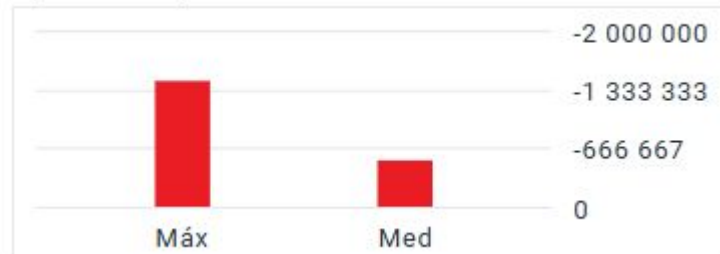


Control de Operaciones

Operaciones ganadoras



Operaciones perdedoras



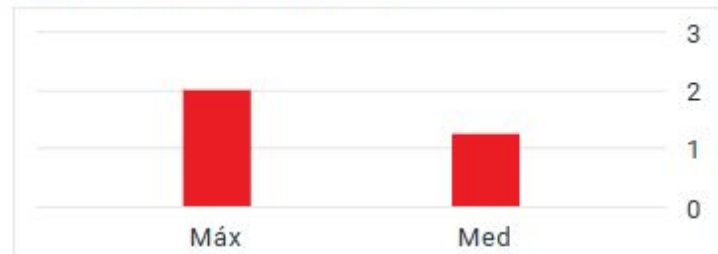
Secuencia de operaciones ganadoras



Duración media de la operación



Secuencia de operaciones perdedoras

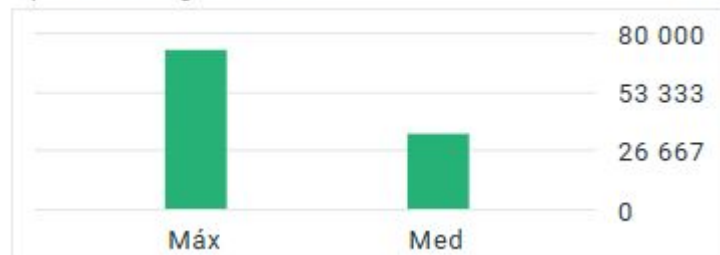




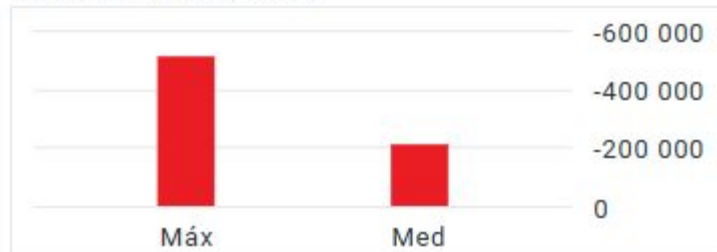
Control de Operaciones



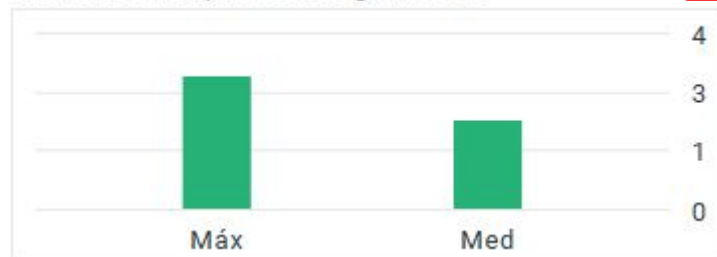
Operaciones ganadoras



Operaciones perdedoras



Secuencia de operaciones ganadoras



Duración media de la operación



Secuencia de operaciones perdedoras





xtb

