



ANALIZA EL VOLUMEN Y SIGUE A LAS BALLENAS

## Detectando la compra de las ballenas

El punto donde un instrumento financiero usualmente termina una tendencia y comienza otra en sentido opuesto, está casi siempre acompañado por una vela con una gran cantidad de volumen o una serie de velas con claro alto volumen. Esto se debe a que las ballenas, los traders institucionales que trabajan para las grandes corporaciones de inversión, manejan cuentas con miles de millones de dólares, tienen ejércitos de analistas, ex compañeros de trabajo que ahora trabajan en el gobierno y por lo tanto son los que tienen la mejor información sobre los mercados y lo que les afecta en tiempo real. Este artículo explica cómo al analizar sistemáticamente el volumen y su relación con el precio, podemos detectar su compra o venta en el gráfico y seguir sus operaciones.

### Incrementando Las Probabilidades De Éxito

Esta estrategia habla de cómo al detectar en el gráfico un volumen muy alto o ultra alto nos anuncia la posible venta o compra de las ballenas. Nótese que no estamos hablando de un volumen ligeramente más alto del volumen promedio. Estamos hablando de un volumen ultra alto, es decir, de un volumen el doble o el triple del volumen promedio. Esta estrategia se basa

en la premisa de que un incremento de este tipo en el volumen en una vela por ejemplo de una hora de una materia prima como el oro o la plata, significa un incremento de millones de dólares en el costo de esos contratos extras.

Solo las grandes instituciones de inversión tienen el poder adquisitivo para en una hora, poder vender o comprar esa cantidad de contratos adicionales. Estos incrementos de volumen nos pueden dar una entrada de alta probabilidad, si van acompañados de señales tácticas tales como una vela envolvente, una vela martillo etc.

O también si se presenta en una vela que forma parte de un patrón chartista tal como doble techo, triple techo, hombros y cabeza etc. Otro elemento que puede incrementar nuestra probabilidad de éxito es si se presenta en un previo nivel de soporte o resistencia o después de superar o penetrar un nivel importante. En el caso de los patrones chartistas, una divergencia mostrada por el RSI de 14 periodos suele añadir a la acumulación de probabilidades a nuestro favor.



#### Carlos Partida

Ingeniero en electrónica quien comenzó a trabajar en los mercados financieros en el 2008.

Es fundador y CEO de TACTICAS DE TRADING LLC y es especialista en las técnicas para detectar la compra y venta de las ballenas en las gráficas.

Ha realizado trading en vivo cada semana con sus cuentas con dinero real desde el 2014.

✉ cp@tacticasdetrading.com

**La estrategia ha de ser flexible y adaptarse en todo momento a la situación del mercado, por tanto no contempla posiciones rígidas de stop de un % fijo**

### El Gran Volumen Antes De La Fuerte Subida En Las Acciones Chinas

El siguiente ejemplo se presentó en un gráfico semanal el pasado octubre en el ETF de compañías tecnológicas de chinas, el KWEB. Esa señal coincidió con la reelección a un tercer término del presidente de China Xi Jinping.

En el gráfico (G1) después de la fuerte caída con un gran gap, podemos ver una vela martillo alcista con una ultra alta cantidad de volumen.

Lo más interesante de este caso es que la reelección del presidente de China, supuestamente era negativo para los mercados ya que hasta entonces el presidente de China había mantenido una política de "Covid Cero" es decir de cerrar toda una ciudad al detectar un solo caso de Covid. Eso había ocasionado un cierre a muchas fábricas en China, que es la fábrica del mundo y escasez de micro chips y otros productos aumentando la inflación y disminuyendo la producción. Todos los periódicos lo reportaron así, como una noticia negativa para los mercados en su momento como un artículo de Bloomberg que salió, en octubre 27, 2022 el cual decía que la reelección de Xi dejaba a las acciones de China Destrozadas".

Sin embargo como podemos ver en el gráfico G1, la señal definitivamente fue acertada mostrando la gran compra de las ballenas. Soportando toda la presión psicológica tanto de las noticias negativas como del fuerte movimiento bajista en el gráfico, entramos en una posición alcista al cierre de la vela a los 18.50, con un stop por debajo del mínimo de la vela en 16.50 con el equivalente a 240 ETFs. Cerramos la mitad al superar la media móvil simple de 200 periodos en el gráfico diario cuando mostraba una ganancia de \$2200 aproximadamente y movimos el stop al de la segunda mitad al precio de entrada y la conservamos hasta el día de hoy para un movimiento mayor.

¿Cómo es esto posible? ¿No eran las noticias referentes a los factores fundamentales y también el análisis técnico totalmente negativos? Bueno, los datos al publico y que por lo tanto nosotros sabíamos sí. Sin embargo, al parecer al grupo de políticos cercanos al presidente Xi, ya les había informado el presidente que, si fuera reelegido, terminaría con la política de "Covid Zero". Las grandes corporaciones de inversión, tienen sucursales en todas partes del mundo y ex trabajadores

trabajando en el gobierno tanto en América como en Europa y Asia. Por lo tanto, se dice que tienen tentáculos en todas partes y se rumora que de alguna manera se les filtró la información de las intenciones del presidente de China de eliminar su política de "Covid Zero" si fuera reelegido. Ya sea que ese rumor sea cierto o que simplemente los analistas de esas corporaciones sean más inteligentes que el resto de nosotros y por lo tanto lo anticiparon, es irrelevante. El caso es que el análisis del volumen ultra alto junto con el patrón de vela japonesa, nos informó de una muy probable compra de las instituciones de inversión y una entrada a tiempo con un pequeño stop y un gran objetivo justo al cambio de tendencia.

**G1 Gráfico diario del ETF de compañías tecnológicas chinas KWEB.**



trabajando en el gobierno tanto en América como en Europa y Asia. Por lo tanto, se dice que tienen tentáculos en todas partes y se rumora que de alguna manera se les filtró la información de las intenciones del presidente de China de eliminar su política de "Covid Zero" si fuera reelegido. Ya sea que ese rumor sea cierto o que simplemente los analistas de esas corporaciones sean más inteligentes que el resto de nosotros y por lo tanto lo anticiparon, es irrelevante. El caso es que el análisis del volumen ultra alto junto con el patrón de vela japonesa, nos informó de una muy probable compra de las instituciones de inversión y una entrada a tiempo con un pequeño stop y un gran objetivo justo al cambio de tendencia.

### El Gran Volumen Que Precede Al Fuerte Movimiento Alcista En El S&P500

Otro ejemplo más reciente sucedió con la crisis de los bancos regionales. Cuando comenzó la crisis con la bancarrota del primer banco el Silicon Valley Bank en marzo de este año, el S&P500 tuvo un fuerte movimiento bajista y todos los indicadores técnicos como el MACD, RIS, Medias Móviles etc apuntaban a la baja y la tendencia en el gráfico diario también era bajista como muestra el siguiente gráfico.

Los principales canales de finanzas mostraban noticias con gran pánico. El New York Times publicó un artículo el 10 de marzo de este 2023 titulado "La falla de un banco sacude a los mercados y envía a las acciones fuertemente hacia abajo" El artículo

## El análisis técnico es una herramienta muy valiosa como ayuda en las inversiones, sin embargo, por sí solo se queda coja

### G2 Gráfico diario del S&P500.



agregaba que "El colapso del Banco del Valle de silicón, añadió preocupación a la economía y el S&P500 sufre su caída más precipitada en una semana en lo que va del año".

Otras acciones de otros bancos regionales comenzaron a caer fuertemente ya que estos bancos comenzaron a tener problemas de liquidez por retiros masivos de los clientes y comenzaron a estar al borde de la bancarrota también. Se hablaba de que esta era la tercera crisis bancaria en la historia de Estados Unidos. Otros expertos se preguntaban en entrevistas en populares medios financieros ¿Tendremos otra crisis como la del 2008? Con todas estas noticias de fundamentales sobre los mercados tan negativas, la inflación todavía muy alta, la reserva federal en medio del ciclo monetario restrictivo y el gráfico mostrando una clara tendencia bajista con todos los indicadores técnicos apuntando a la baja era una locura comprar, comentaban algunos expertos.

Sin embargo, el análisis de volumen junto con la acción de precio una vez más salvan el día. El volumen nos mostraba una posible fuerte compra en esos niveles de parte de las ballenas. En realidad, el volumen es el más grande en una vela del gráfico diario del contrato de futuro continuo del S&P500 desde la vela donde se detuvo la caída en octubre. El patrón de velas japonesas que nos da en ese punto es una especie de "Estrella de la mañana", un patrón de velas japonesas alcista y ¡dos de

las tres velas tienen una gran cantidad de volumen!

Una vez más tuvimos que sobreponernos a toda esa presión psicológica negativa e incertidumbre de parte de todos los principales medios de comunicación financieros y a todas las señales negativas de todos los indicadores técnicos y la tendencia bajista en el gráfico. Por lo que tuvimos que confiar en el análisis sistemático del volumen y la acción de precio para apretar el gatillo y comprar en esos niveles.

Ese resultó ser el mínimo en la corrección y de allí hemos tenido un fuerte movimiento alcista en el S&P500 hasta el día en que escribimos este artículo ¡de más de 500 puntos!

¿Cómo es esto posible? ¿Qué no era todo tan negativo en ese momento? Como ya hemos dicho antes, las grandes corporaciones de inversión se dice que tienen tentáculos en todas partes. Muchos ex trabajadores de instituciones financieras trabajan ahora en el gobierno. Un ejemplo entre muchos otros es Brian Deese quien fue Director de inversiones globales para BlackRock en el 2017 y en el 2020 Biden lo nombró el treceavo Director del Consejo Nacional Económico.

Por lo que se rumora que de alguna manera se les filtro a las corporaciones de inversión antes que saliera al público, la noticia de que ya estaba la reserva federal y la secretaria del tesoro, planeando un rescate a los bancos regionales a los que se les terminó dando \$300,000 millones de dólares. Otros dicen que no, que simplemente sus analistas son más inteligentes que el resto de nosotros y lo dedujeron.

Cualquiera que sea el caso es irrelevante. Las señales que nos daba el volumen eran claras y decidimos comprar dos contratos de opciones call del ETF UPRO que es un ETF que sigue el movimiento el S&P500 pero apalancado. Las opciones las compramos adentradas en el dinero con un delta 70 y una fecha de vencimiento hasta enero del 2024.

Al momento de escribir este artículo, tenemos una ganancia de \$2200 la cual corresponde al +140% del valor que pagamos por las opciones. Estamos por cerrar un contrato para guardar

## El análisis se realiza sobre gráfico diario, posteriormente se pasa a volver a realizar sobre gráfico horario

ganancias ya que el movimiento se encuentra muy extendido.

Lo que convirtió a este trade en un trade de muy alta probabilidad es la acumulación de factores como los ya mencionados y también el hecho de que varias velas después de la señal también mostraban gran volumen y patrones como vela martillo alcista.

### El Gran Volumen Que Precede De A La Caída En El Gas Natural

Este tipo de señales también las tenemos en gráficos más pequeños como el trade que mostramos a continuación. Es un trade en venta corta en un CFD del gas natural. En el gráfico podemos ver la señal de una vela envolvente y si vemos el volumen de la vela bajista es enorme. Si comparamos el volumen de las demás velas de una hora durante días antes y después, veremos que ninguna vela tiene un volumen tan grande.

En el contrato de futuros era todavía más notorio pero este ejemplo demuestra que incluso en un bróker no centralizado de CFDs y de Forex en marcos temporales más pequeños, muchas veces nos dan esas señales de enormes cantidades de volumen, rompiendo un poco el mito de que "No se puede analizar el volumen por no ser un Exchange centralizado". Si ese fuera el caso, tampoco se podría analizar el precio ya que no es un Exchange centralizado y el movimiento en ese bróker en particular, se basaría en la compra y venta que tuviera en un momento dado. Pero eso no puede ser así por lo que tienen mecanismos de arbitraje encargados de neutralizar los desbalances de suministro o demanda con respecto al mercado en general lo cual influye no solo en el precio, sino que también en el volumen.

En esta cuenta entramos con un micro contrato 0.01 y cerramos el trade con una ganancia de 122 ticks / pips. Demostrando que no es el tamaño de la cuenta lo que importa sino la estrategia utilizada junto con la paciencia y buenas técnicas de control de riesgo, lo que nos da los buenos resultados.

Como verán la estrategia tiene elementos flexibles y no reglas extremadamente rígidas ¿Por qué? Porque sabemos que las estrategias con reglas muy rígidas no funcionan a largo plazo.

### G3 Gráfico diario del S&P500 y el ETF URPO que sigue al S&P500.



Ya que intentan imponer un sistema estático al dinámico movimiento de los mercados. En los mercados al igual que en la vida, recordemos que como se ha dicho, sobrevive el que mejor se adapta.

En conclusión, el esperar pacientemente señales de volumen ultra alto (dos o tres veces mayor al volumen promedio en una vela o varias velas juntas con gran volumen) y combinarlo con patrones de velas japonesas, patrones chartistas, niveles de líneas de tendencia etc. nos puede mostrar donde están comprando las ballenas. Es casi como convertirnos ética y legalmente en su socio secreto.

Nombre de Estrategia:	Detectando las operaciones de las ballenas
Tipo de Estrategia:	Contra tendencia
Horizonte temporal:	Múltiples marcos temporales
Setup:	Velas con enorme cantidad de volumen y patrones de velas japonesas y / o chartistas
Entrada:	Al cierre de la vela/ velas con el patrón y gran cantidad de volumen
Stop-Loss:	Debajo de los mínimos de la vela de entrada
Take Profit:	Siguiente nivel importante
Trailing-Stop:	Cerrar la mitad en el primer objetivo y mover stop de la otra mitad al precio de entrada
Salida:	Segundo nivel importante
Gestión monetaria y de riesgo:	Arriesgamos no más de un 2% de la cuenta
Numero de señales promedio :	Varía según volatilidad y noticias importantes
Beneficio/ganancias	1 a 2 mínimo de riesgo beneficio