UTILIZACIÓN DEL RSI (RELATIVE STRENGTH INDEX)

¿Existe una estrategia simple y confiable para invertir?

Sin duda alguna una de las formas más simples de comenzar en este mundo del trading, es una estrategia basada en este indicador, con muy buenos resultados, y reglas claras de aplicación.

Gabriel Montalto
Cuenta con 17 años de experiencia en el sector financiero, habiendo trabajado para una empresa del grupo Deutsche Bank en Alemania, en donde posteriormente se incorporó a un Bróker de derivados financieros en Alemania. Durante 12 años ocupó el cargo de director general para dicho Bróker alemán en España y Latinoamérica, habiendo sido él quien dio a conocer por primera vez los CFDs en España en 2006.
Desde hace dos meses representa como director para España a Tradimo.
✉ gabriel@tradimo.com

Más de 10 años experimentando

He dedicado mucho tiempo tanto al estudio como desarrollo de muchas estrategias para el trading, algunas muy simples y otras más complejas, todas con sus pro y contras.
Pero como todo en el mundo del trading, existen inversores que desean estrategias complejas ya que esperan mejores resultados, y otros que las prefieren más simples pero con similares porcentajes de aciertos.

El RSI nos servirá para detectar un posible movimiento antes de que comience.

Si bien todo se basa en la estadística, independientemente de la estadística de una estrategia, cada trader es un mundo aparte y propio.
No es lo mismo un trader que realiza 10 operativas a la semana, o al día, que otro que realiza estas operativas en 6 meses. Quiero decir con esto que simplemente cuando llevo haciendo algo cien o doscientas veces, me será más sencillo saber cómo serán mis próximas diez veces. Mientras que si mi propia estadística no tiene datos suficientes (opero o invierto pocas veces), será más difícil conocer cómo soy y actúo en el trading, y no podré tampoco asegurarme mis futuras inversiones.
Por otro lado invertir u operar más veces no implica ni debería implicar aumentar pérdidas, ya que si domino la gestión del riesgo y del capital, podré perder un 40% sobre mi capital, tanto en cien trades, como en veinte, o en doscientos trades.

¿Qué es y cómo funciona el RSI?

Es un oscilador desarrollado por J. Welles Wilder, de hecho, es uno de los osciladores más seguidos a lo largo de los años. Además, es uno de los pocos que nos permite detectar un posible cambio de la tendencia siendo igual el time frame o lapso de tiempo que analicemos.
A diferencia de otros indicadores u osciladores que nos darán datos "atrasados", el RSI nos servirá para detectar un posible movimiento antes de que comience, y sobre todo un giro o cambio de la tendencia respecto a la anterior.
El oscilador busca calcular una proporción de fuerza relativa (RS, Relative Strength):

Fórmula:

$$RS(n) = \frac{\text{Media de los cierres al alza de los últimos "n" períodos}}{\text{Media de los cierres a la baja de los últimos "n" períodos}}$$

Adaptaremos la RS de modo que fluctúe entre 0 y 100

$$RSI(n) = 100 - \frac{100}{(1 + RSI)}$$

Propiedades:

a) Es un indicador adelantado a la curva de precios.
b) Detecta sobre todo la fortaleza o debilidad de la tendencia.
c) Oscila entre una banda de 0 y 100, delimitando de esta forma zonas de sobrecompras y sobreventas (70 – 30 ; 80 – 20).

¿Cuándo se produce una señal?

Importante para responder adecuadamente a esta pregunta es ante que nada definir el lapso de tiempo a utilizar en un gráfico, o sea 5M, 15M, 30M, 1H, o diario. A nivel personal tanto en 15M, 30M, y en 1H, es donde aparecen las mejores señales para operar.
Para que exista una señal de compra o de largos deberá el precio tener una tendencia bajista según el tiempo analizado. Este precio debería detenerse en algún momento, y debería al mismo tiempo coincidir con un RSI en niveles iguales o inferiores a 30. En este momento estaríamos frente a un posible rebote sin conocer objetivos, pero probable.
Por otro lado, para que exista una señal de venta o de cortos el precio debe venir en tendencia alcista, dicho precio debería detenerse en algún momento, y coincidir esta vez con un RSI en niveles de 70 o superior.
Siempre deberán suceder dos cosas tanto para los largos como para los cortos, que el precio venga de una tendencia alcista/bajista y que el RSI (con precio detenido) se encuentre por encima de los 70 o por debajo de los 30.
Podremos utilizar la gestión que mejor nos parezca para operar con esta estrategia. Según mis propias conclusiones tiene una fiabilidad que oscila entre un 37% y un 40%, de hecho este dato tiene también una explicación como consecuencia de que un precio podrá solo subir, bajar o mantenerse independientemente del lapso de tiempo que necesite.

¿Cómo funciona en el corto plazo o intradía?

Aquí me remito a lo comentado anteriormente que tiene más fiabilidad la estrategia si la utilizo en 15M,

F1 Gráfico del DAX30 en diario

Veamos como en zonas de color verde aparecen las señales de compra, y en zonas rojas las señales de venta.

Fuente: Visualchart

F2 Gráfico del DAX30 en 15M

Como podemos observar las señales son más, pero al mismo tiempo aumenta en 15M las que no resultan tan beneficiosas. Pese a esto el ratio de aciertos se mantiene. Así es que podremos ir cómodamente con un ratio de riesgo/beneficio de 1/2, o de 1/3.

Fuente: Visualchart

30M, 1H o diario. De lo contrario podrían aparecer más señales "falsas".

Cuando utilizo el RSI, tomo como referencia el último mínimo relevante para un largo, y el último máximo relevante para un corto. Bastará colocar un SL (stop loss), un poco por encima de ese máximo para un corto, y un poco por debajo de ese mínimo para un largo.

En el gráfico del US30 cash 1H las líneas rojas deberían haber sido las zonas de protección para estos trades, y las amarillas para la zona de objetivo, o de recogida de beneficios, calculadas según la gestión

Para que exista una señal de compra o de largos deberá el precio tener una tendencia bajista según el tiempo analizado.

F3 Gráfico con el US30 cash 1H (Dow Jones Industrial contado)

He marcado con círculos verdes dentro del RSI las zonas de posibles largos, y zonas para posibles cortos. Además, dentro del gráfico he marcado nuevamente la coincidencia con los precios, tanto para comprar como para vender.

Fuente: MT5

del riesgo que expliqué anteriormente aproximadamente 3 a 1.
Las señales más fiables fueron aquellas por encima del 70 y por debajo del 30, aunque a veces también funcionan en niveles muy cercanos a los 70 y los 30.
De las aproximadamente 8 señales que se pudieran haber detectado en este gráfico, 5 de ellas habrían dado un resultado positivo, tomando como última señal el corto generado entre el día 9 y 10 de enero de 2020, y pese a estar en beneficio aun no ha llegado a su objetivo bajista.

Conclusión y apoyo técnico

En mi último artículo comenté la estrategia mediante el uso de la vela maestra, y la vinculaba con el buen uso del RSI, ahora que les he presentado esta forma de operativa, podréis hacer pruebas combinándolas.

Esta estrategia como comenté anteriormente es una de las más simples de entender y utilizar, cuenta con muchos retractores ya que muchos traders esperan mejores resultados, si estos provienen de estrategias más complejas.
Esto último no puedo ratificarlo pese a llevar más de una década analizando el comportamiento de los precios.
Por lo que puedo concluir que a veces en la simpleza puede estar la respuesta correcta, y que muchas veces nuestro comportamiento psicológico es nuestro peor enemigo en el mundo del trading.