

2016

INDICADOR OBI

MANUAL DEL USUARIO

VERSION 1.0.0B

DTP OBI | www.daytraderprofesional.com

INDICE

1. Introducción
 - a. Level II
 - b. Imbalance
2. Instalación
3. Desinstalación de versiones previas
4. Localización del indicador en la plataforma NinjaTrader
5. Descripción general
 - a. Lógica
 - b. Parámetros
 - c. Menú
6. Precauciones

Indicador OBI

Versión 1.0.0b

www.daytraderprofesional.com

1. INTRODUCCION

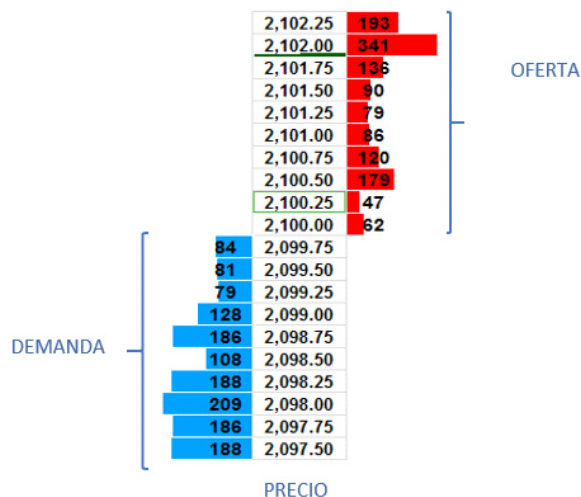
La oferta y la demanda son una parte imprescindible en la comprensión de los mercados actuales, junto a las acciones que compradores y vendedores realizan a diario. Seguramente todos estamos muy acostumbrados a comprar o vender, pero por ser un entorno virtual quizás perdemos de vista un aspecto importante de la ecuación, con quien negociamos.

Todo comprador necesita un vendedor, y a la inversa. A través de las herramientas actuales podemos observar las compras y ventas que se realizan, pero también la oferta o demanda disponible. En la estructura actual de los mercados, todo aquel que quiere comprar, accede a ello mediante quienes ofertan. Todo aquel que quiere vender lo hace a través de quienes demandan. Por tanto, existe una relación directa e imprescindible entre quienes compran o venden y entre quienes ofertan o demandan.

A. LEVEL II

Conocido también como Order Book, es la representación de la oferta y la demanda que está disponible en un mercado. Dependiendo del mercado que observemos nos encontraremos que tendremos más o menos información disponible, pues no todos los mercados dan la misma profundidad de mercado.

En la siguiente foto se muestra la profundidad de mercado o Level II disponible para el mini SP 500, 10 niveles por lado:



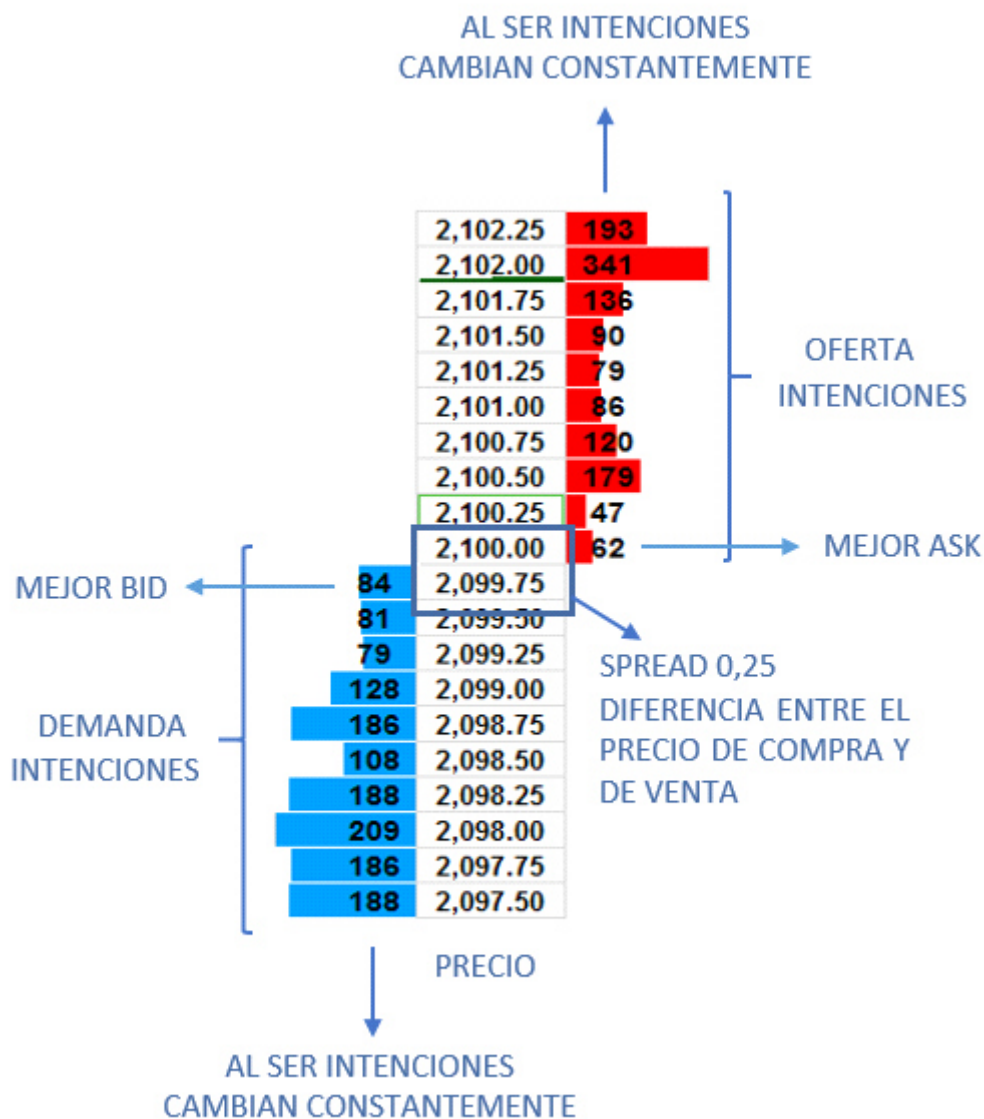
Indicador OBI

Versión 1.0.0b

www.daytraderprofesional.com

Aunque en la foto no se aprecia, la oferta y demanda visible a través de cualquier mercado cambia constantemente, añadiendo y quitando órdenes, tan rápido, que es prácticamente imposible el seguimiento de las mismas. Toda orden en el Level II, antes de ser ejecutada, puede ser eliminada o añadir a una cantidad previamente disponible.

En la siguiente foto se hace una descripción algo más detallada de lo anteriormente comentado:

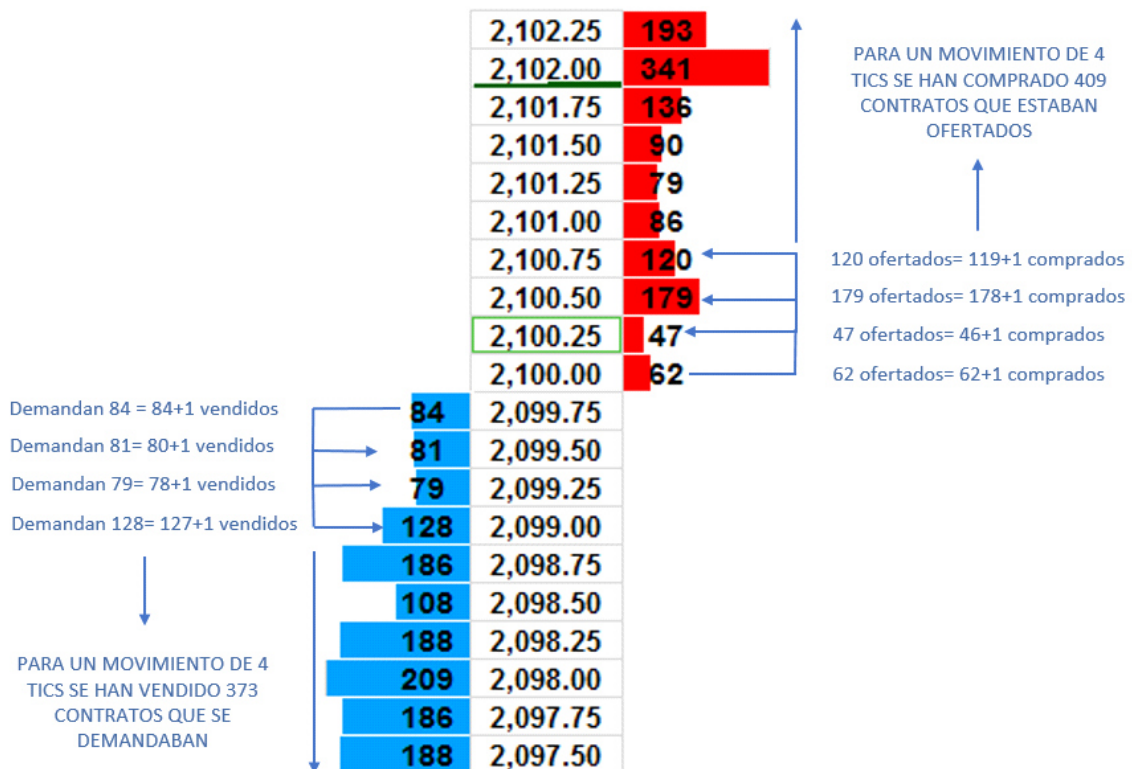


Indicador OBI

Versión 1.0.0b

www.daytraderprofesional.com

A continuación se detalla a través de una imagen, cómo se produce el movimiento en el mercado, pues tiene su base en el Level II:



En la foto se muestra como en un momento determinado, se está negociando el precio de venta en 2,099.75 y el precio de compra en 2,100.25. En esos dos niveles tenemos a 62 ofertados y 84 demandados. Para que el precio se mueva un tic, tiene que existir en el caso de la demanda, 84 vendedores para absorber toda la demanda, más 1 para negociar el siguiente nivel 2,099.50 donde hay 81 demandados, que restándole el que ya se ha negociado, dejaría un total de 80 demandados en ese precio. En el caso de la oferta, hay disponibles 62 y por tanto tiene que haber 62 compradores para absorber toda esa oferta, más 1 para negociar el siguiente nivel, 2,100.25 donde hay 47 ofertados, que restándole el que ya se ha negociado, dejaría un total de 46 ofertados en ese precio.

Este hecho parece muy sencillo, pero tiene grandes implicaciones. Que ocurriría si en un nivel de precio determinado, por ejemplo en 2,099.75 en vez de haber 84 demandados, hubieran 2500? Eso significa que deberían existir 2501 vendedores para que el precio se moviera un solo tic.

Otra situación, imagina que hay esos mismos 84 demandados en ese precio, pero finalmente el volumen ejecutado de venta es de 2500. Eso puede significar diferentes cosas. Una de ellas es que demandados han ido añadiendo en ese precio más demanda de la inicial de 84. Las intenciones de hacer esto, pueden ser varias, como agotar a vendedores o crear una absorción, acciones básicas para detener un movimiento direccional. Otra opción es que ha habido demandados que han querido comprar a esos niveles y los vendedores han estado de acuerdo en negociar a ese nivel. Llegar a conocer realmente las intenciones de los que participan activamente, es muy complicado, pues el mercado es un mar de intereses particulares y nosotros solo somos meros espectadores sin capacidad a nivel individual de tener efecto alguno en el mercado.

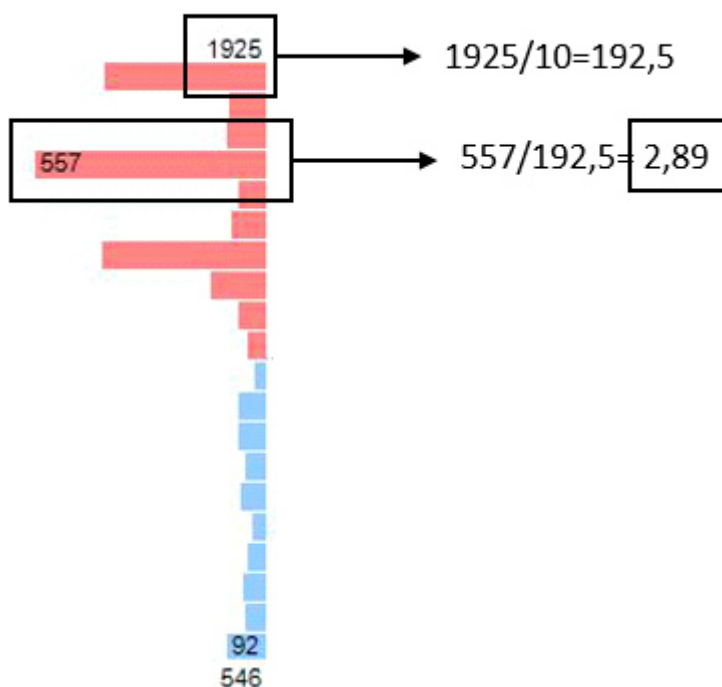
Ya sabemos un poco más sobre el Level II, algo imprescindible de entender si vas a utilizar el indicador OBI.

B.DESBALANCE

Entenderemos por desbalance, la pérdida del equilibrio en las órdenes de oferta o demanda, ya sean comparadas de forma individual, oferta y demanda o en conjunto, oferta contra demanda. Como equilibrio definiremos toda cantidad que en relación o comparación frente a otra u otras, sea parecida. Por ejemplo, si tenemos 2500 ofertados en un precio específico y comparando esa cantidad con las otras nueve, en el caso del mini SP, observamos que en todas ellas existen cantidades que van entre los 2000 y 2200. En este caso podríamos decir, que con respecto a la cantidad de 2500 comparada con las demás, existe un desequilibrio, pues esta es mayor que el resto.

Vamos a comentar otra situación algo diferente, pero usando la misma oferta de 2500 en un precio específico. Si comparamos el resto de niveles y observamos que la cantidad oscila entre los 900-1000, en este caso el desbalance es más evidente.

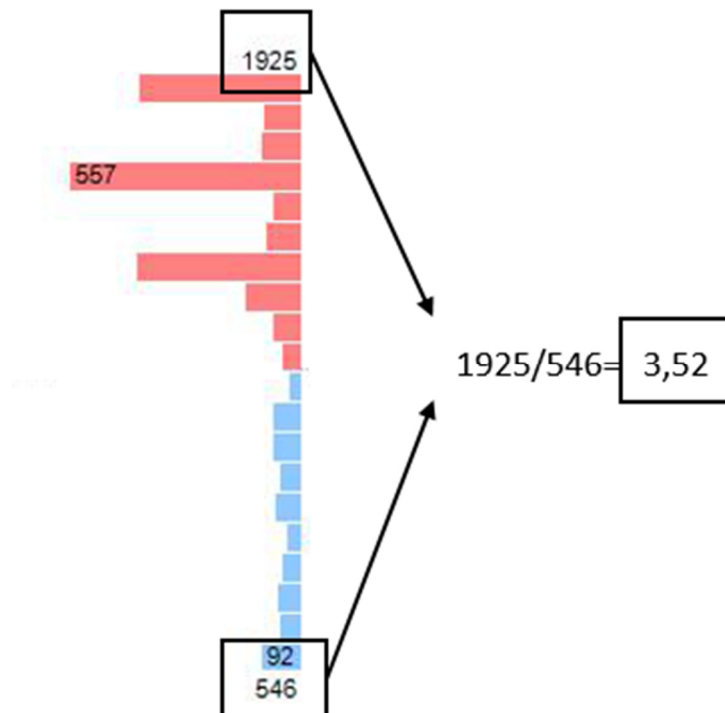
En la siguiente imagen se puede observar un desbalance en la oferta:



Si sumamos todas las ofertas disponibles, tenemos un total de 1925 ofertados. Si hacemos una media, indicaría la cantidad de 192.5 como oferta media. Sin embargo, podemos observar una oferta específica de 557, lo que muestra una diferencia entre su media de 2.89 veces. Podríamos decir pues, que existe un desbalance dentro de la propia oferta. Esto también podría suceder dentro de la demanda, aunque no se explique ningún ejemplo.

Anteriormente se comentó que podría existir también un desbalance entre oferta y demanda, no analizadas de forma independiente, sino comparativamente entre ambas. El concepto tras ese desbalance es el mismo que el anterior pero tomando como referencia la suma total de ambos y determinando su diferencia para poder establecer una diferencia específica.

En la siguiente imagen se puede apreciar de forma muy clara un desbalance entre oferta y demanda:



Como se observa, la suma total de la oferta es de 1925 y la suma total de la demanda es de 546. Esta diferencia genera un desbalance muy claro, puesto que en 1925 cabe 3.52 veces la demanda total en ese preciso momento.

El conocer estos detalles ayudara en la comprensión de uso del indicador, pues son las dos lógicas que usa. Detecta básicamente desbalances en la oferta y demanda por separado y entre la oferta y la demanda, comparativamente.

Indicador OBI

Versión 1.0.0b

www.daytraderprofesional.com

2. INSTALACION

Para poder usar el indicador, deberás usar el archivo que recibirás al adquirir el mismo, que instalará el indicador en tu NinjaTrader, siguiendo unos pasos muy sencillos y casi intuitivos. Si tienes NinjaTrader abierto, deberás cerrarlo antes de empezar con la instalación. Si tienes alguna versión previa instalada, sigue las instrucciones del apartado desinstalación, antes de empezar el proceso de instalación. En las siguientes capturas podrás observar los pasos a seguir, tras hacer doble clic en el archivo instalador que has recibido.



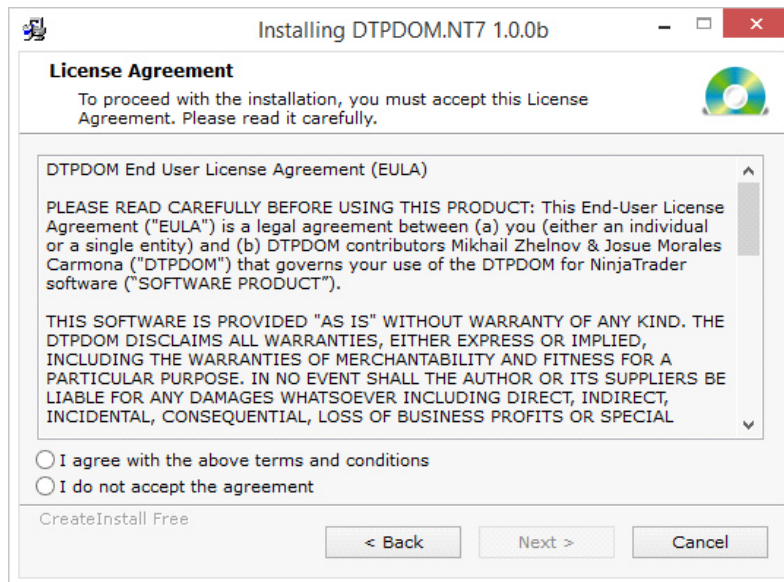
Como se observa en la imagen, tras hacer doble clic, aparecerá la pantalla de bienvenida a la instalación del indicador, donde deberás hacer clic en Next para iniciar el proceso de instalación.

Indicador OBI

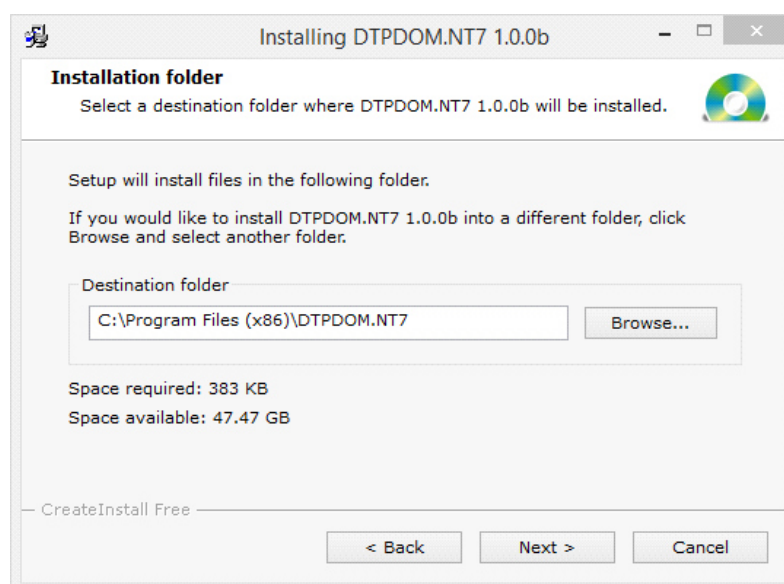
Versión 1.0.0b

www.daytraderprofesional.com

A continuación aparecerá la siguiente pantalla con el acuerdo de la licencia:



Deberás aceptar los términos de la misma, para poder instalar el indicador. Haz clic en “I agree with the above terms and conditions”. Al seleccionar esta condición, el botón Next se podrá clicar para continuar con el proceso de instalación. Clicando en Next, aparecerá la siguiente pantalla:

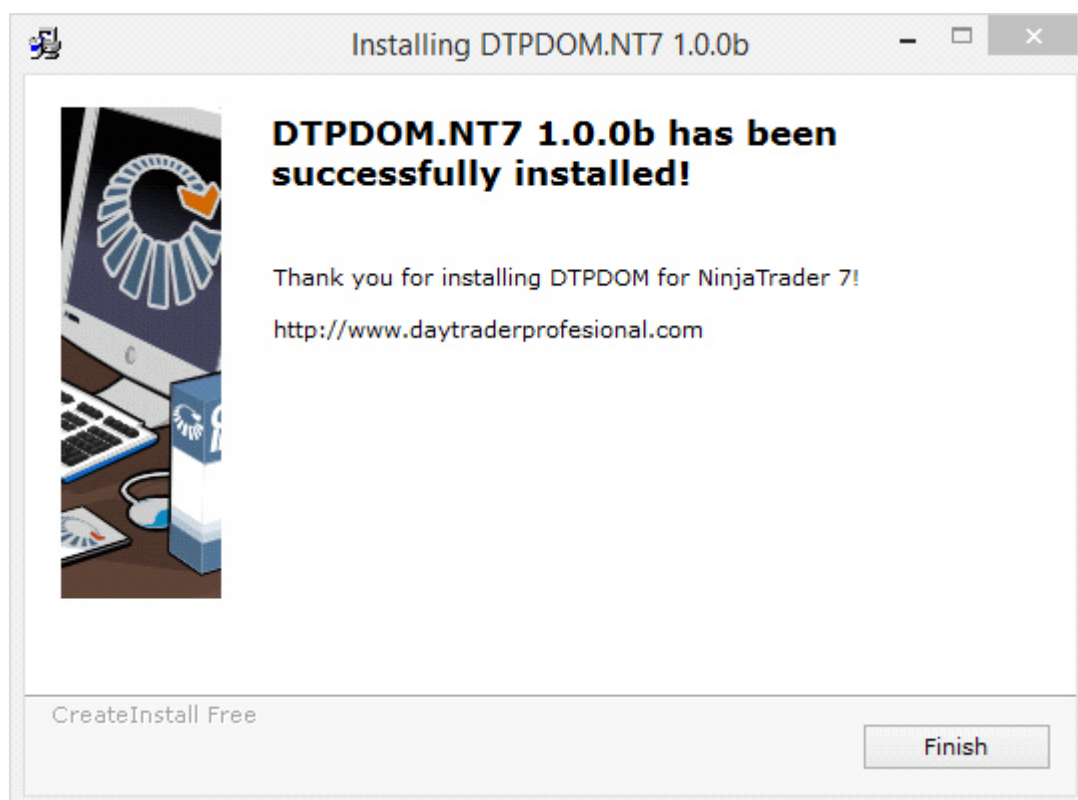


Indicador OBI

Versión 1.0.0b

www.daytraderprofesional.com

En esta pantalla te permite cambiar la carpeta de instalación. Si no eres un usuario avanzado, clicas en Next sin cambiar nada. En ese momento, comenzará la instalación del indicador. Si has todos los pasos explicados previamente, veras la siguiente pantalla indicándote que se ha instalado correctamente:



Clica en la pestaña Finish para cerrar esa ventana, y ya tienes instalado el indicador. Como ves es un proceso muy simple e intuitivo. Ahora ya puedes usarlo en tu NinjaTrader.

3. DESINSTALACIÓN DE VERSIONES PREVIAS

En el caso de tener una versión previa instalada, debes seguir unos sencillos pasos para eliminarla y así poder instalar nuevas versiones.

En este caso, abriremos nuestra plataforma NinjaTrader y en nuestra pantalla de Control Center clicaremos en File/Utilities/Remove NinjaScript Assembly. Nos aparecerá una pantalla en la que podremos escoger la versión previa para eliminarla. Buscamos el indicador, llamado DTP OBI y después de seleccionarlo, clicamos en el botón Remove.

Listo, ya tenemos desinstalado el indicador. Para instalar una nueva versión, recuerda que debes cerrar NinjaTrader.

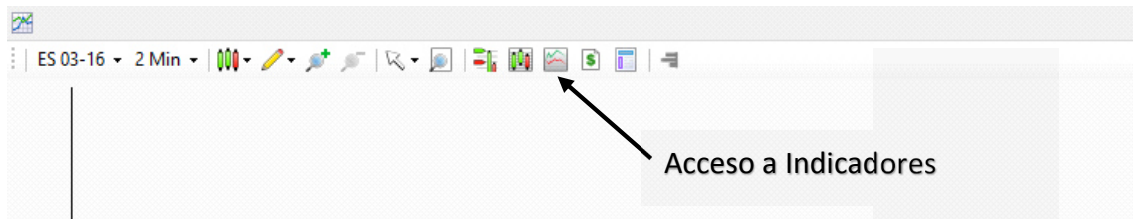
Indicador OBI

Versión 1.0.0b

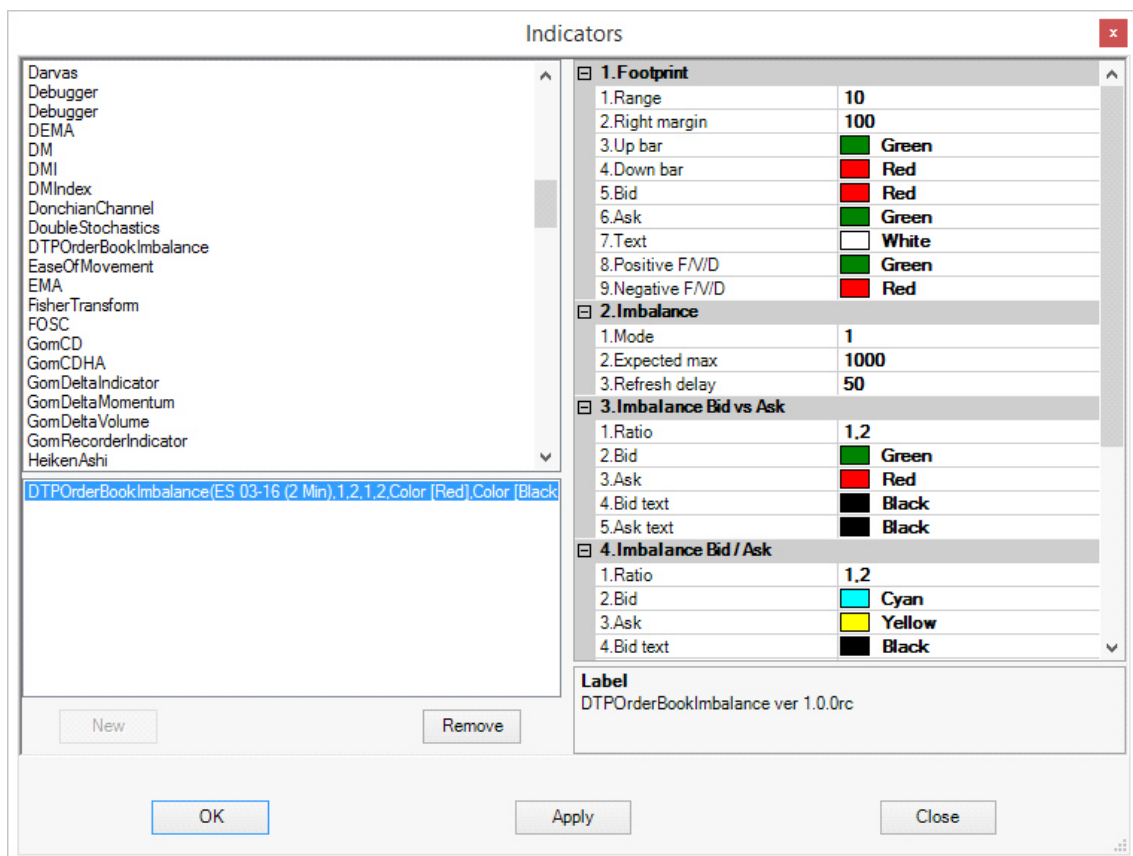
www.daytraderprofesional.com

4. LOCALIZACION DEL INDICADOR EN LA PLATAFORMA NINJATRADER

Una vez está instalado el indicador ya podremos acceder a él a través de la forma normal de hacerlo en el caso de la plataforma de NinjaTrader, como puede ser a través de un gráfico y clicando en indicadores. En el menú que hay en cada grafico se puede acceder a través del icono indicado en la siguiente foto:



Clicando en ese botón, nos aparecerá la siguiente pantalla:



5. DESCRIPCION GENERAL (LOGICA, PARAMETROS, MENU)

En esta pantalla ya podremos acceder a cambiar los settings del indicador y aplicarlo a gráficos, en este caso en el gráfico donde hayamos abierto la ventana.

Los settings del indicador:

1. Footprint

Range: permite escoger el rango que se quiera del footprint, por defecto es 10

Right Margin: permite desplazar el footprint del margen derecho del grafico la distancia que se quiera. Pueden ser valores negativos o positivos. De ser negativos, desaparecerá de la pantalla.

UP bar: Definir el color para definir una vela positiva

Down bar: Definir el color para definir una vela negativa

Bid: Definir el color para el Bid (Ventas)

Ask: Definir el color para Ask (Compras)

Text: Definir el color del Texto

Positive F/V/D: Definir el color para un Finish/Volumen/Delta positivo

Negative F/V/V: Definir el color para un Finish/Volumen/Delta negativo

2. Imbalance:

Mode: Se puede escoger dos lógicas. Bid vs Ask y Bid/Ask. La primera detectara imbalances entre la oferta y la demanda, en comparación y solo generara el mapa en el lado que esté generando el desbalance. En el caso de Bid/Ask lo hará de forma independiente y el mapa se generará para todas las órdenes que provoquen un desbalance, ya sean de oferta o demanda.

3. Imbalance Bid vs Ask:

En esta sección puedes cambiar todo lo relacionado con esa lógica, tanto ratio, como colores tanto de Bid/Ask como el color del texto.

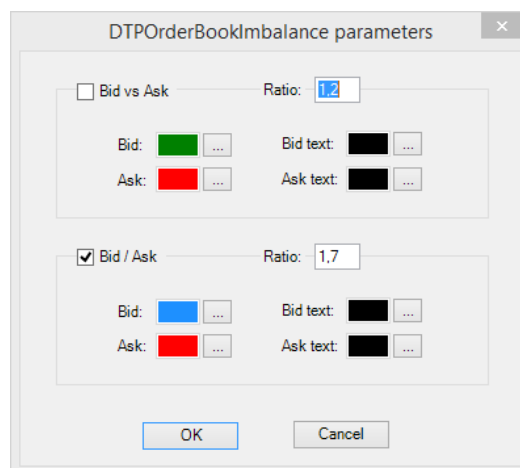
4. Imbalance Bid/Ask:

En esta sección puedes cambiar todo lo relacionado con esa lógica, tanto ratio, como colores tanto de Bid/Ask como el color del texto.

El resto de settings no es necesario modificar nada para que le indicador funcione o esté a nuestra preferencia operativa o personal. Una vez aplicado al gráfico, nos aparece un icono en la barra superior, donde podremos acceder a ciertos settings del indicador para hacer los cambios necesarios en las lógicas.



Clicando en ese logo nos aparecerá el siguiente menú:



6. PRECAUCIONES

El indicador no guarda histórico, por tanto, es importante no refrescar el gráfico. Cada vez que el gráfico se refresca, ya sea al clicar F5 o al hacer algún cambio en la venta de los settings del indicador, la información obtenida previamente se borrará.

Esa es la razón de que existe el menú de acceso rápido a los settings básicos desde el mismo gráfico. De esta forma se pueden cambiar parámetros sin refrescar el gráfico y sin perder información.

Este manual es una orientación sobre la puesta en marcha del indicador y así como su uso. Si quieres observar un video manual, puedes hacerlo en la siguiente página web:

<https://www.daytraderprofesional.com/servicios/indicadores/obi.html>

En la mitad de la página encontrarás un video, explicando estos mismos detalles.