

Cheatsheet operativo — Método Investep

Referencia compacta para preparar, identificar y gestionar operaciones. Las fuentes nombradas remiten a las notas de clase del repositorio; este documento resume el método, pero los ejemplos gráficos siguen viviendo en esas clases.

Trading = waiting. Si no se cumplen todos los requisitos de una estrategia, no hay entrada.

Manifiesto

Antes de abrir un trade:

- Reconozco que el mercado es probabilístico y este trade es desconocido e irrelevante para mi éxito en el largo plazo.
- Acepto el resultado de este trade. Si es positivo, genial. Si es negativo, es normal y esperado. Ningún resultado cambia mi valor personal ni mi plan.
- Estoy comprometido con el proceso. Mi único trabajo es ejecutar mi plan a la perfección. Lo único que está bajo mi control es mi riesgo, mi entrada y mi salida. El resultado no es mi responsabilidad.

Checklist premarket

Productividad no es hacer más; es seguir el plan.

1. Bitácora y orden

- Definir el activo y la tesis en una frase.
- Anotar el **precio** previsto de entrada.
- Calcular la **cantidad** según el capital permitido por el plan.
- Calcular y dejar listo el **límite de salida**.
- Verificar el **rango óptimo** del contrato: bid/ask, strike, expiración y liquidez adecuados.
- Registrar qué invalida la tesis antes de entrar.

2. Bollinger, líneas y niveles

- Revisar Bollinger Bands en **15 minutos, 1 hora y 1 día**.
- Identificar tendencia, punto medio, apertura/cierre de volatilidad y precio expuesto en cada temporalidad.
- Trazar **trendlines** en **1 hora y 15 minutos**.
- Marcar **H lines** relevantes, incluidos **ATH y ATL**.
- Distinguir claramente entre setup, confirmación e invalidación.

3. Medias, velas y confirmaciones

- Revisar medias móviles **20/40/100/200** en **1 hora y 1 día**.
- Leer los pares de forma independiente: **20/40** y **100/200**.
- Confirmar: alcista = **20 sobre 40**; bajista = **40 sobre 20**.
- Leer el candlestick más reciente y buscar vela de confirmación cuando la estrategia la exija.
- Revisar volumen y Worden Stochastic como confirmaciones auxiliares; no convertirlos por sí solos en una entrada.

4. Contexto de mercado

- Revisar posibles **movimientos en bloque** y activos correlacionados.
- Identificar el activo adelantado y el rezagado; no asumir correlación sin confirmación en ambos gráficos.
- Revisar la fecha de la próxima decisión o conferencia de la **FED**.
- Revisar **earnings** y si son BO o AC.
- Revisar fundamentales: **target price, recomendación de analistas y market cap**.
- Revisar operaciones de insiders o **insider information pública**; nunca operar con información material no pública.
- Confirmar calendario de expiración del producto y tiempo restante.

5. Decisión final

- Nombrar la estrategia o señal exacta.
- Confirmar que están presentes todos sus requisitos.
- Confirmar que encaja en el plan elegido y en su riesgo permitido.
- Si falta claridad, **esperar**.

Despacio, que voy de afán. Recuerda la meta.

Familias de estrategias

Las doce variantes originales se agrupan en seis familias. Cada familia indica su lado alcista y bajista sin repetir la misma

explicación dos veces.

Familia 1 — Cambio de tendencia en 1 hora

Partida	Tendencia bajista	Tendencia alcista
Trendline	Sobre los máximos	Bajo los mínimos
Ruptura	Punto medio + trendline	Punto medio + trendline
Confirmación	Vela alcista en 1H + 15M alcista con volatilidad	Vela bajista en 1H + 15M bajista con volatilidad
Posición	CALL	PUT
Plan principal	35% o 100%, según duración y estructura	35% o 100%, según duración y estructura

Las dos rupturas son obligatorias, aunque no ocurran en el mismo precio o vela. La entrada llega después de la confirmación horaria, no al primer toque.

Familia 2 — Rebote en punto medio diario

Corrección en 1H	Alcista hacia el punto medio	Bajista hacia el punto medio
Nivel	Punto medio diario marcado antes de abrir	Punto medio diario marcado antes de abrir
Trigger	Respeto el nivel y empieza a rebotar en 15M	Respeto el nivel y empieza a rebotar en 15M
Confirmación	Vela bajista en 1H	Vela alcista en 1H
Posición	PUT	CALL
Plan asociado	35% o 100%	35% o 100%

El día define la dirección dominante; la hora muestra la corrección. “Tocar el punto medio” detecta el setup, pero la entrada espera respeto, rebote 15M y confirmación 1H.

Familia 3 — Lateralidad y apertura fuera de Bollinger

Esta familia 5/6 es la excepción que permite operar **sin volatilidad abierta**. Es esporádica y ocurre en los primeros minutos de la sesión.

Contexto 15M	Lateral, sin volatilidad	Lateral, sin volatilidad
Apertura	Gap muy por encima de banda superior	Gap muy por debajo de banda inferior
Trigger	Empieza a bajar	Empieza a subir
Posición	PUT	CALL
Ventana	Primeros 5 minutos	Primeros 5 minutos
Salida	Primer retroceso definido por el plan	Primer rebote definido por el plan

Pasada la ventana inicial, el setup puede perder validez. Los resultados extraordinarios citados en clase son ejemplos, no objetivos operativos.

Familia 4 — Efecto imán

Orden 20/40	40 sobre 20	20 sobre 40
Apertura	Gap fuerte a la baja	Gap fuerte al alza
Extensión	Muy debajo de MA20	Muy encima de MA20
Bollinger 15M	Primera vela completamente fuera, sin tocar la banda	Primera vela completamente fuera, sin tocar la banda
Confirmación auxiliar	Candlestick + volumen/Worden	Candlestick + volumen/Worden
Posición	CALL	PUT
Destino técnico	Regreso hacia MA20	Regreso hacia MA20
Plan asociado	35% o 100%	35% o 100%

La primera vela de 15 minutos debe terminar antes de entrar. Volumen y Worden acompañan la lectura; no sustituyen la tendencia, la extensión ni Bollinger.

Familia 5 — Cambio de tendencia en 15 minutos

Partida	Bajista o lateral	Alcista o lateral
Gap de apertura	Al alza	A la baja
Ruptura	Punto medio + trendline superior	Punto medio + trendline inferior
Confirmación	Volatilidad 15M abre al alza	Volatilidad 15M abre a la baja
Posición	CALL	PUT
Plan principal	10%	10%

El gap forma el setup en la apertura. La entrada puede darse después si las rupturas y la volatilidad siguen válidas; eso no significa que aparezca un gap nuevo a cualquier hora.

Familia 6 — Estrategia del millón

Partida	Canal lateral mínimo de 10 días	Canal lateral mínimo de 10 días
Medias	20/40/100/200 entrelazadas; predominan 100/200	Igual
Niveles	Dos H lines delimitan el canal	Igual
Movimiento inicial	Gap o vela fuertemente alcista	Gap o vela fuertemente bajista
Confirmación	Rompe H line superior + volatilidad en 1H	Rompe H line inferior + volatilidad en 1H
Posición	CALL	PUT
Plan asociado	100%	100%

El gap es una alternativa, no un requisito. La ruptura confirmada del canal es el trigger. El siguiente H line relevante es el primer destino técnico.

Señales de movimiento

Una señal llama la atención; solo se vuelve operable después de revisar medias, H lines, temporalidades superiores, noticias y el plan.

M1 — Movimiento saliendo desde Bollinger

- El precio abre dentro de Bollinger.
- Sale con fuerza en la dirección del punto medio.
- La volatilidad se abre de forma continua, no en escalera engañosa.
- El precio todavía no está expuesto al momento de entrar.
- Medias y H lines dejan espacio al movimiento.

Temporalidad principal: 15 minutos. **Plan asociado:** 10%. La salida se gestiona cuando se alcanza el objetivo del plan, el precio queda expuesto o la volatilidad se fractura/cierra.

Otros movimientos que deben marcarse

- Primeros puntos de rebote en medias móviles.
- Precio expuesto en Bollinger, disipadores o medias.
- Movimiento en bloque: usar el activo adelantado como confirmación del rezagado, validando ambos gráficos.

Estos movimientos no se cuentan como estrategias completas sin contexto.

El salto (gap)

Un salto es la diferencia entre el cierre de un día y la apertura del siguiente. Solo puede formarse entre sesiones; puede ser alcista o bajista. Es una señal de inicio o continuación, pero **no reemplaza el panorama completo**.

Regla de protección

Mientras el movimiento posterior no atraviere el cierre del día anterior en la dirección contraria, el salto conserva su estructura. Si lo atraviesa, la tesis debe reevaluarse según la estrategia y el plan.

Primer salto válido

- El precio rompió los techos o pisos relevantes.
- Las medias cortas se cruzaron en la nueva dirección y superaron las medias 100/200 pertinentes.
- La siguiente sesión abrió con gap.
- Existe terreno libre hasta el siguiente nivel relevante.

El primer salto válido tiene mayor peso. El segundo todavía puede confirmar la tendencia; desde el tercero su fuerza suele disminuir. “Primero” significa primero con estructura y terreno libre, no simplemente el primero visible.

Entrada después de un salto

- Si la posición ya estaba abierta, se mantiene mientras la estructura y la línea de cierre anterior no sean invalidadas.
- Si no había posición, se espera confirmación en **1 hora**: respeto del cierre anterior y vela a favor del gap.

Segundo salto: señal M2

Un segundo salto cerca del inicio o final de una tendencia puede reconfirmar el movimiento. Se detecta en diario y se ejecuta solo si el panorama completo confirma dirección, espacio, earnings y niveles. No tiene por sí solo un objetivo ni una entrada universal; se trata como **señal**, no como estrategia autónoma.

Menos es más: un gap sin espacio ni confirmación no es una oportunidad.

Planes y gestión de riesgo

Cada operación pertenece a **un plan**. Sus reglas nunca se convierten en reglas transversales para los demás.

10%	30–50% de la cuenta; nunca más de 50%	Corte manual alrededor de -20% según el plan	No permitido	Cambio de tendencia 15M; M1 saliendo de Bollinger
35%	Máximo 10%	Revaluar tesis y tiempo; no universalizar un stop	Permitido con el mismo capital inicial	Cambio 1H; rebote en punto medio; efecto imán; precio expuesto
100%	10% de la cuenta	Requiere experiencia, tiempo y panorama completo	Permitido si cumple todos sus requisitos	Cambio/inicio de tendencia; rebote; efecto imán; estrategia del millón
Activos 25%	Cuenta de activos separada	Según horizonte del activo	Puede promediarse sin depreciación temporal de opciones	Plan mensual de activos

Los porcentajes son objetivos del plan, no promesas de una estrategia. Una estrategia puede aparecer en más de un plan según duración, riesgo y manejo de la posición.

Recuerda la meta: cumplir el plan vale más que capturar todo el movimiento.

Refuerzo

El refuerzo reduce el costo promedio agregando contratos del **mismo producto**. No pertenece al plan del 10% y solo se usa cuando todos sus requisitos están presentes.

Requisitos

- La posición inicial fue abierta correctamente y la tesis sigue vigente.
- La posición tiene una pérdida de **50% o más**.
- Se utiliza **el mismo capital de la inversión inicial**.
- Se compra exactamente el mismo tipo, expiración y strike.
- El plan permite el refuerzo y el DTE deja tiempo suficiente para ejecutar la gestión definida.
- Si el contrato es **0-DTE** (vence el mismo día), el refuerzo se hace únicamente entre la apertura y las **10:00 a. m., hora de Nueva York**.
- Los puntos de entrada son puntos de rebote (**MM y H lines**) del panorama completo.

Como la prima ha bajado, el mismo capital puede comprar **más contratos** que al inicio. Después de la ventana permitida no se refuerza: un strike o vencimiento nuevo se evalúa como una posición separada.

En productos con expiración diaria o múltiple semanal, el DTE manda. En activos, el tiempo no deprecia una prima, pero la tesis debe seguir vigente.

Antes de una pérdida de 50% —por ejemplo -25%, -30% o -35% — agregar contratos se considera potenciar, no reforzar.

El ejercicio de abrir deliberadamente una posición contraria solo se realiza en **paper money** para practicar la mecánica; no elimina el requisito de haber abierto correctamente una operación real.