

Sunrise Indicator



Come dalla prima ora di contrattazione estrapolare il Sunrise Point per effettuare operazioni vincenti su Titoli, Indici, Valute e Commodities

Sunrise Indicator

Come dalla prima ora di contrattazione estrapolare il Sunrise Point per effettuare operazioni vincenti su Titoli, Indici, Valute e Commodities

Titolo

“ Sunrise Indicator ”

Autore

www.proiezioniidiborsa.com

Editore

www.proiezioniidiborsa.com

Siti internet

www.proiezioniidiborsa.com



ATTENZIONE: questo ebook contiene i dati criptati al fine di un riconoscimento in caso di pirateria. Tutti i diritti sono riservati a norma di legge. Nessuna parte di questo libro può essere riprodotta con alcun mezzo senza l'autorizzazione scritta dell'Autore e dell'Editore. **È espressamente vietato trasmettere ad altri il presente ebook**, ne' in formato cartaceo ne' elettronico, ne' per denaro ne' a titolo gratuito. Tutti i nomi di prodotti o aziende citati nel testo sono marchi registrati appartenenti alle rispettive società e sono usati a scopo editoriale e a beneficio delle relative società.



ATTENZIONE: investire in Borsa è rischioso

Le strategie riportate in questo libro sono frutto di anni di studi e specializzazioni, quindi non è garantito il raggiungimento dei medesimi risultati economici. I risultati passati ottenuti dall'autore non forniscono alcun tipo di garanzia per i guadagni futuri.

Il lettore si assume piena responsabilità delle proprie scelte economiche e finanziarie, consapevole dei rischi connessi a qualsiasi forma di investimento in Borsa.

I casi di studio e gli esempi contenuti nel testo sono frutto di notizie e opinioni che possono essere modificate in qualsiasi momento senza preavviso e non costituiscono sollecitazione all'acquisto o alla vendita di valori mobiliari e al pubblico risparmio.

L'unico scopo è di fornire elementi di studio sull'andamento dei mercati, pertanto non possono essere considerate come previsioni certe e non mettono al riparo dal rischio insito nelle operazioni di investimento in titoli.

L'Autore e l'Editore declinano ogni responsabilità su eventuali inesattezze dei dati riportati, danni, perdite economiche, danni diretti o indiretti derivanti dall'uso o dalla divulgazione delle informazioni contenute in questo libro.

SOMMARIO

Sommario.....	6
Prefazione.....	7
Introduzione	8
Il Sunrise Indicator.....	9
Definizione e sua applicazione	9
Sunrise e il Future FTSEMIB.....	11
Sunrise e il DAX Index	49
Un TS sul Future FTSEMIB basato sul Sunrise Indicator	60
Anno 2009	61
Anno 2008	65
Anno 2007	69
Il Sunrise Indicator applicato al time frame settimanale.....	70
Future FTSEMIB	71
Dow Jones	80
DAX Index.....	86
Unicredito	91
EuroDollaro	95
Conclusioni	99

PREFAZIONE

Quante volte ci siamo detti "Ah se potessi sapere qual'è per oggi il livello critico del mercato sul quale voglio investire !". In questo Ebook, per livello critico si intende un livello di prezzo che se violato (al rialzo o al ribasso) in chiusura (di un time frame che andremo a definire) determina forti movimenti direzionali intraday.

Questo indicatore, infatti, è particolarmente adatto per l'operatività intraday, anche se risulta essere un buon indicatore su diversi Time Frames.

Noi abbiamo trovato una risposta alla domanda "Qual è il livello critico ?" applicando il detto popolare "Il buongiorno si vede dal mattino", da cui il nome dell'indicatore "Sunrise" che vuol dire alba.

Nelle prossime pagine vi spieghiamo come costruire questo indicatore, vi mostreremo sue applicazioni su svariati Indici e Azioni, ed infine discuteremo anche un semplice modo per far diventare l'Indicatore stesso un Trading System.

Che la Vita vi sorrida Sempre !

Proiezionidiborsa

INTRODUZIONE

Noi siamo convinti che i Mercati si muovano seguendo dei criteri fatti di equilibri matematici, e che questi equilibri, condizionino nella maggioranza dei casi, le future sorti delle quotazioni.

In questo Ebook, leggerete di un Indicatore semplicissimo, ma se andrete a guardare le quotazioni storiche, ritroverete che nella sua semplicità, questo è di una disarmante "genialità".

Avete mai pensato, che la prima ora di contrattazione di un Titolo, Valuta, Indice o Commodities, potesse influenzare le sorti dell'intera giornata di contrattazione ?

Avete mai notato che i valori della prima ora, funzionano come forza attrattiva durante l'intera giornata di contrattazione ?

Nelle prossime pagine vi riporteremo dei grafici, alcuni sono commentati, altri (senza commento) invitiamo a studiarli.

Entriamo nel pieno dei nostri Studi.

IL SUNRISE INDICATOR

L'idea di questo indicatore ci è venuta pensando a qualcosa che potesse darci il polso del Mercato dopo l'apertura.

Dopo aver osservato i movimenti post-apertura di innumerevoli Indici, Azioni, Valute e Commodities siamo giunti alla conclusione che esiste un prezzo tipico, che si forma dopo le prime battute dei prezzi, che condiziona l'andamento di tutta la giornata borsistica.

Come vedremo nelle pagine seguenti il suo calcolo è molto semplice e può essere utilizzato sia come valore di supporto (nel caso di un mercato rialzista) che come valore di resistenza (nel caso di un mercato ribassista).

Poiché crediamo che il modo migliore per rendere il lettore, familiare con l'indicatore in questione è quello di discutere esempi pratici, nelle prossime pagine discuteremo insieme alcune decine di grafici di borsa.

Definizione e sua applicazione

Per i Mercati/le Azioni/i Futures che in Europa aprono le contrattazioni alle 9:00 e chiudono alle 18:00, il Sunrise Indicator (SI) è definito come

OMISSIS

Dove OMISSIS rappresentano, rispettivamente, OMISSIS realizzati nel corso della OMISSIS di contrattazione.

Alla chiusura delle OMISSIS se il prezzo è superiore al SI allora la tendenza intraday di breve è rialzista, se invece è inferiore al SI allora la tendenza intraday di breve è ribassista. Comunque, grande cautela quando :

la tendenza è rialzista, ma la barra OMISSIS;

la tendenza è ribassista, ma la barra OMISSIS.

Ora, la domanda è ? Come faccio a capire se la tendenza individuata alla chiusura delle 10:00 viene negata ?

A conclusione dei nostri studi possiamo affermare che la chiusura della barra a 15' è la più efficiente nell'identificare inversioni della tendenza giornaliera, **ma ciò non toglie**

che il lettore possa personalizzare la propria operatività.

Cosa devo fare allora ?

Alla chiusura di ogni barra a 15' devo andare a verificare se la sua chiusura è superiore o inferiore al valore del SI.

Senza perderci in lungaggini inutili andiamo a discutere con esempi pratici l'applicazione di questo indicatore.

Prima, però, una nota di carattere esplicativo. Nei grafici riportati nelle pagine seguenti :

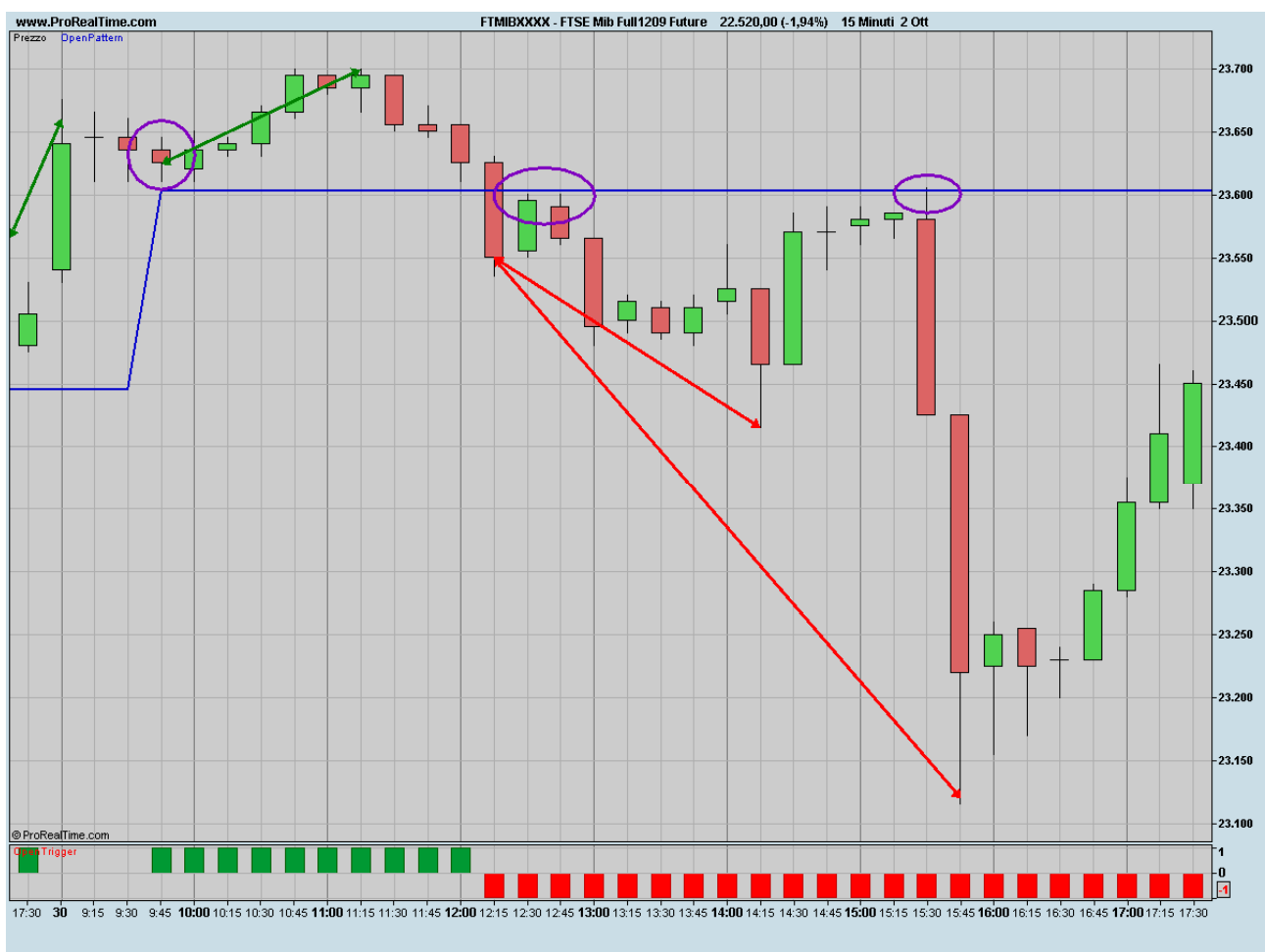
- ✓ La linea blu rappresenta il valore del Sunrise Indicator;
- ✓ L'istogramma mostrato nella parte inferiore del grafico indica se la chiusura a 15 minuti è stata superiore (colore verde) o inferiore (colore rosso) al valore del Sunrise Indicator;
- ✓ L'orario riportato sull'asse delle ascisse indica quello di inizio della barra. Ad esempio la barra in corrispondenza delle 9:45 indica la barra che si chiude alle 10:00 ed è quella da andare a controllare per individuare la tendenza giornaliera.

SUNRISE E IL FUTURE FTSEMIB



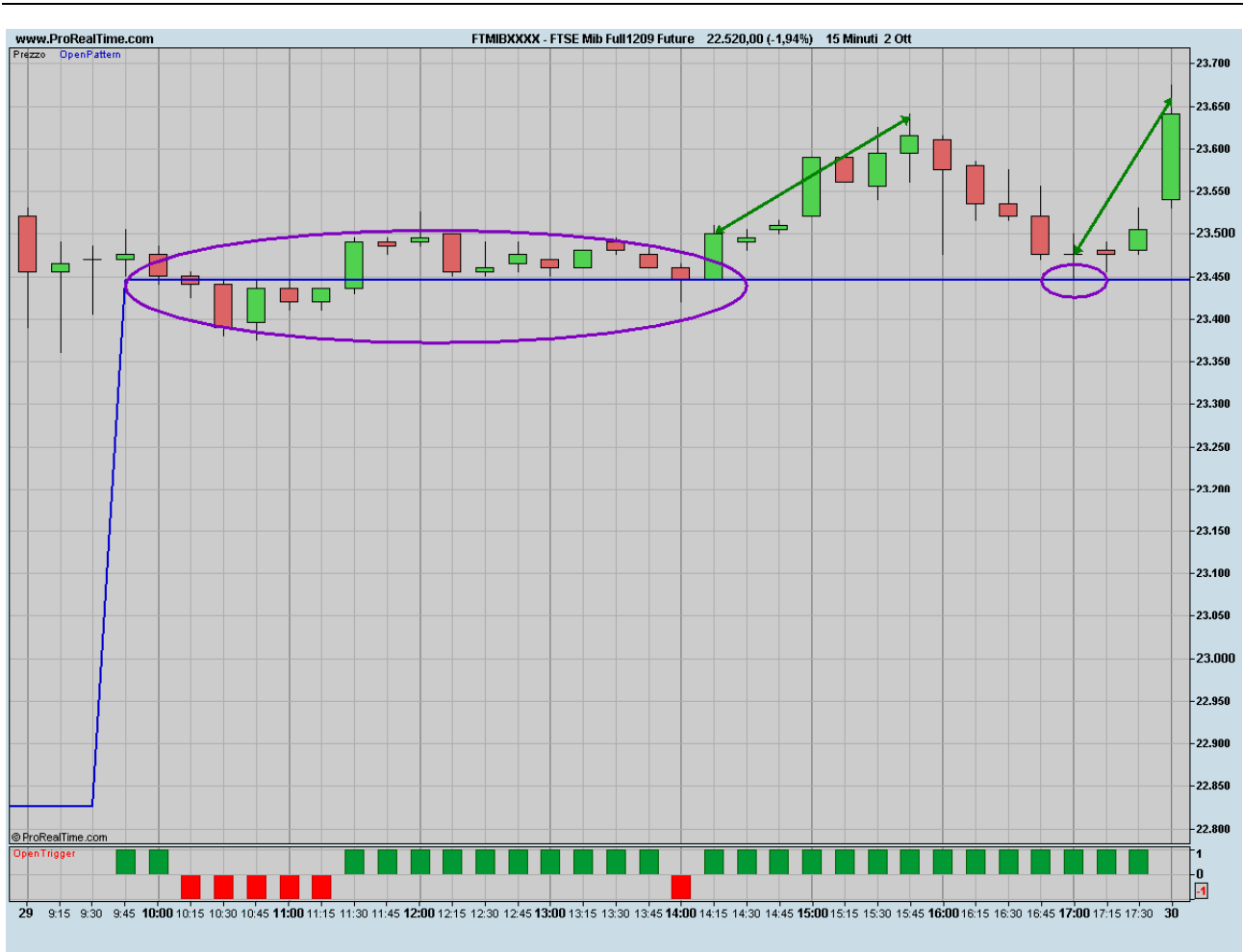
Alla chiusura delle 10:00 (la barra è indicata da un'ellisse viola) il prezzo è superiore al SI per cui la tendenza sarebbe rialzista, ma notiamo come la chiusura sia inferiore all'apertura. In questi casi la cautela è d'obbligo.

Infatti dopo che nella successiva mezzora il SI ha arginato i tentativi di discesa fungendo da supporto, alle 10:45 la chiusura è stata inferiore del SI e i prezzi sono crollati da area 23400 in area 22700.



Alla chiusura delle 10:00 (la barra è indicata da un'ellisse viola) il prezzo è superiore al SI per cui la tendenza sarebbe rialzista, ma notiamo come la chiusura sia inferiore all'apertura. In questi casi la cautela è d'obbligo.

Alla chiusura delle 12:30 la tendenza diventa ribassista e dopo i tentativi nella successiva mezz'ora di chiudere sopra il SI, i prezzi sono crollati da area 23600 in area 23100. In particolare, il crollo si è avuto dopo un ulteriore tentativo dei prezzi di chiudere sopra il SI.

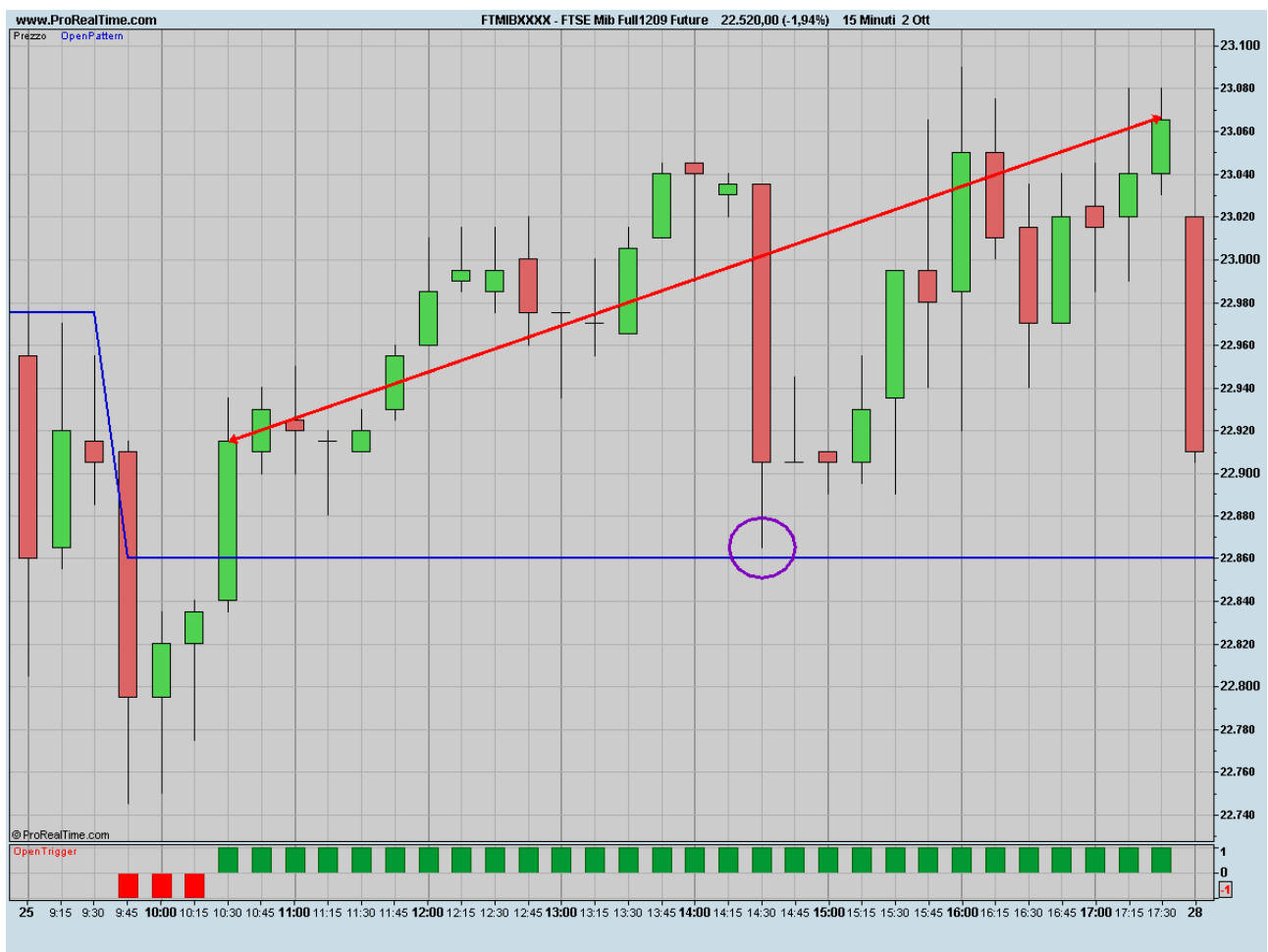


In questo caso fino alle 14:00 le quotazione hanno oscillato intorno al valore del SI, salvo poi salire come previsto dalla chiusura delle 10:00.



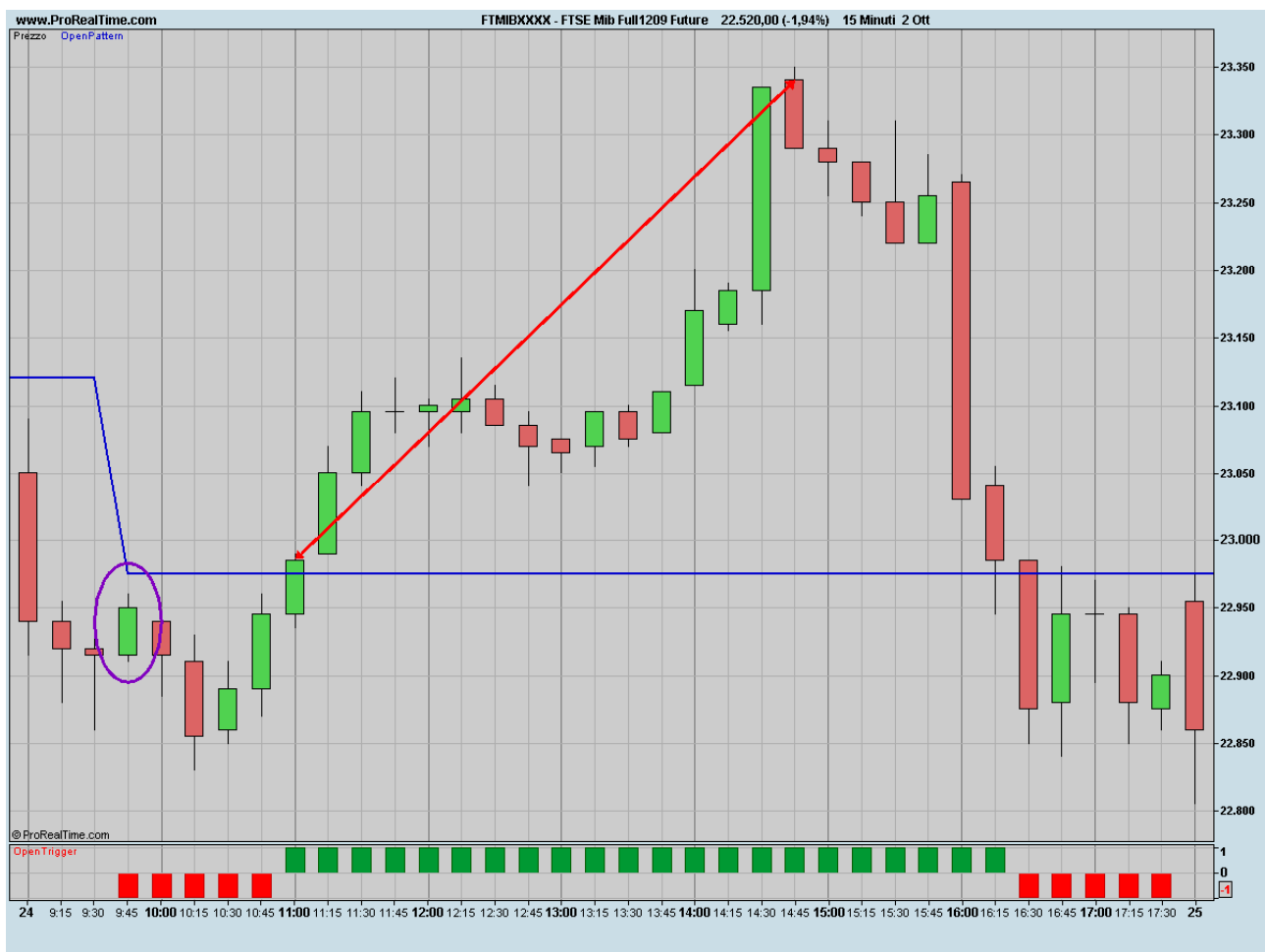
Alla chiusura delle 10:00 (la barra è indicata da un'ellisse viola) il prezzo è inferiore al SI per cui la tendenza sarebbe ribassista, ma notiamo come la chiusura sia superiore all'apertura. In questi casi la cautela è d'obbligo.

Alle 10:45 i prezzi si portano sopra il SI invertendo la tendenza giornaliera. Dopo un test dall'alto del SI, le quotazioni sono salite per tutto il giorno portando il future da area 22850 in area 23450.



Alla chiusura delle 10:00 (la barra è indicata da un'ellisse viola) il prezzo è inferiore al SI per cui la tendenza è ribassista.

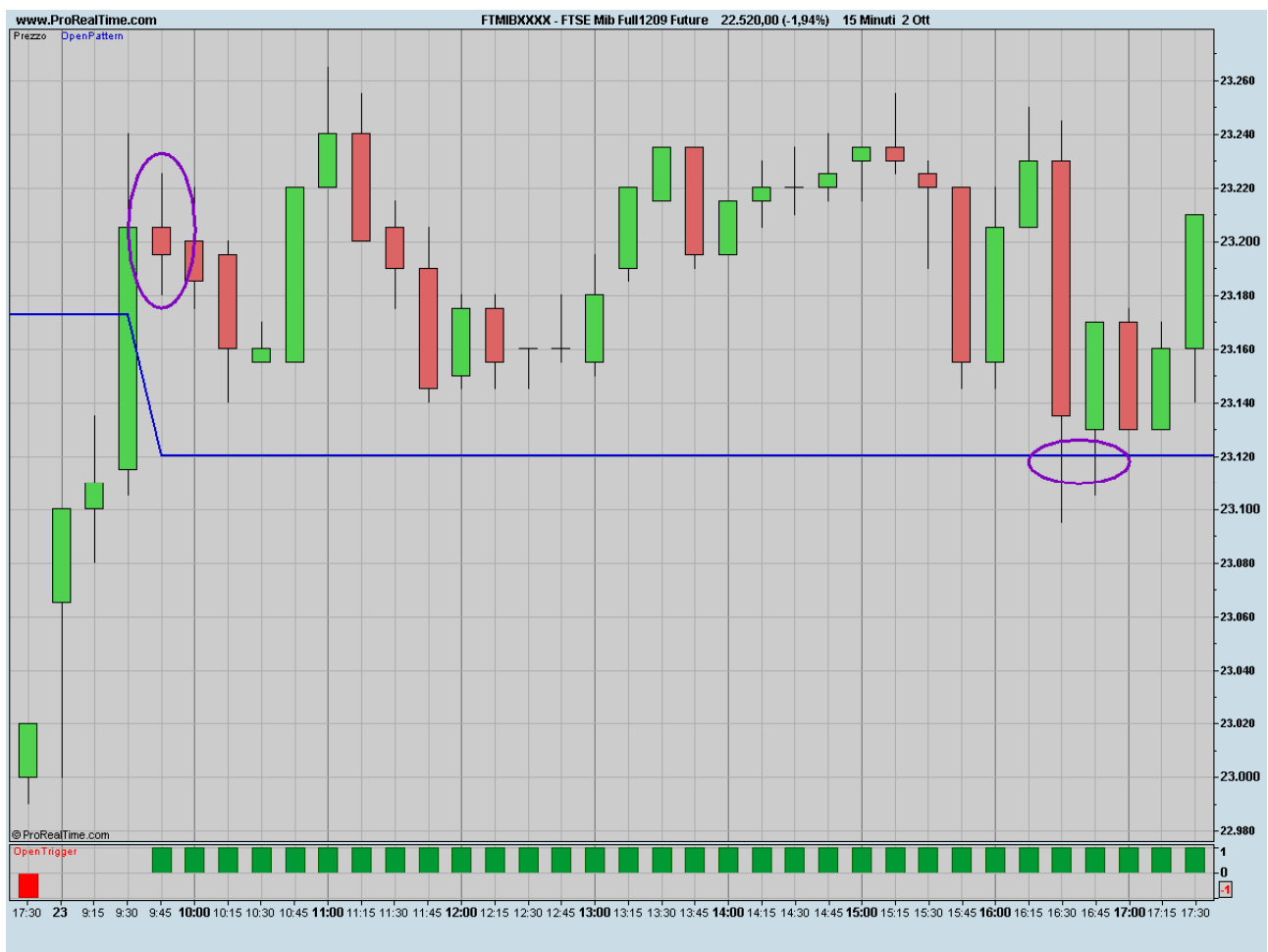
Successivamente alla chiusura delle 10:45 la tendenza diventa rialzista (con una perdita di circa 100 punti) con le quotazioni che si portano da area 22900 in area 23050.



Alla chiusura delle 10:00 (la barra è indicata da un'ellisse viola) il prezzo è inferiore al SI per cui la tendenza sarebbe ribassista, ma notiamo come la chiusura sia superiore all'apertura. In questi casi la cautela è d'obbligo.

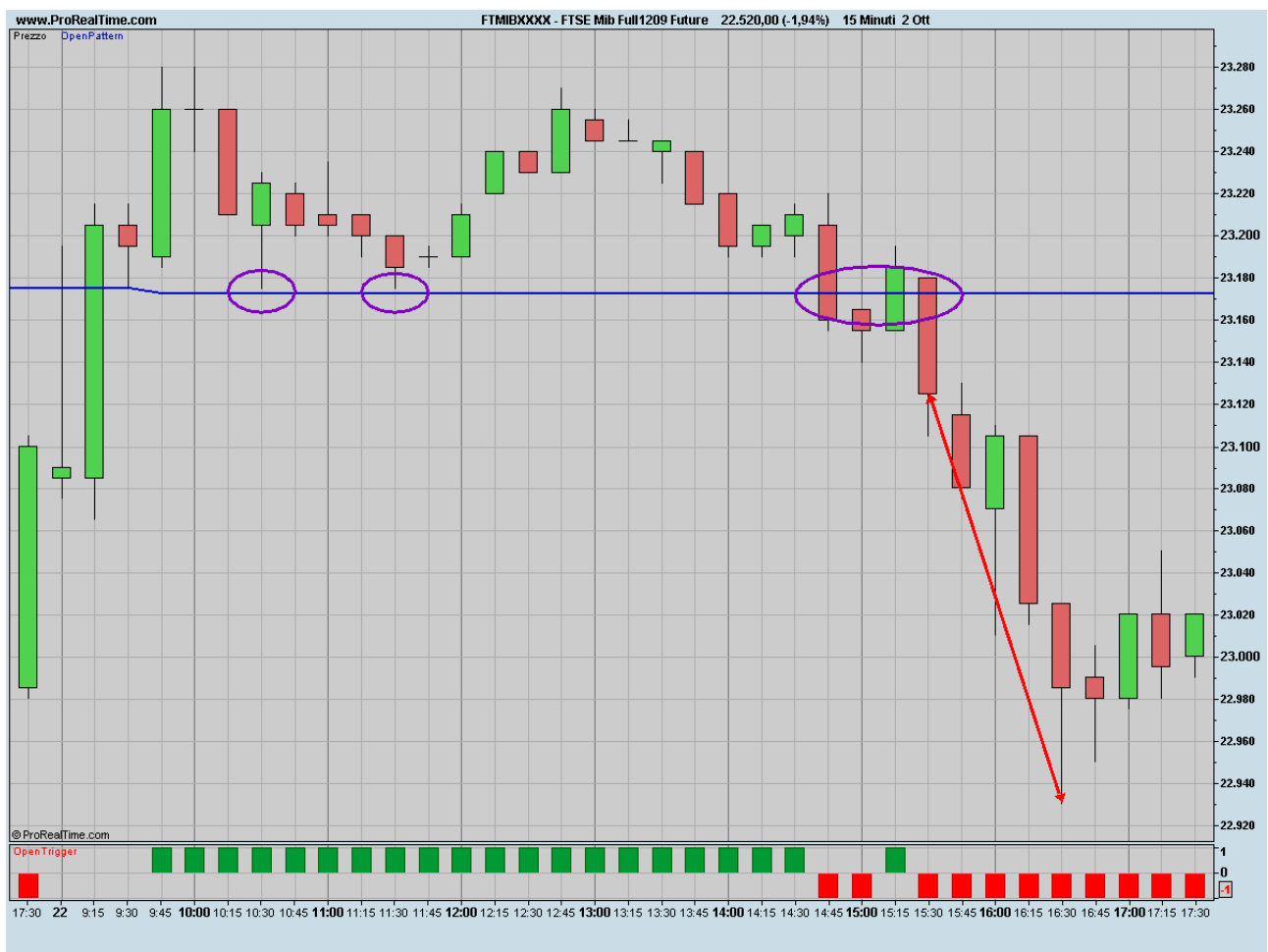
Alle 11:15 il prezzo è superiore al SI per cui la tendenza diventa rialzista e porta le quotazioni da area 23000 in area 23350 con una variazione di circa l'1.5%. Alle 15:00, però, le quotazioni incominciano a scendere fino a riportarsi sui valori del SI.

L'andamento di questa giornata ci fornisce lo spunto per dire che se le quotazioni sono "lontane" dal SI, allora ci si deve affidare ad altri strumenti per individuare possibili inversioni intraday. In questo caso il SI può essere usato solo per definire un valore di supporto/resistenza.



Alla chiusura delle 10:00 (la barra è indicata da un'ellisse viola) il prezzo è superiore al SI per cui la tendenza sarebbe rialzista, ma notiamo come la chiusura sia inferiore all'apertura. In questi casi la cautela è d'obbligo.

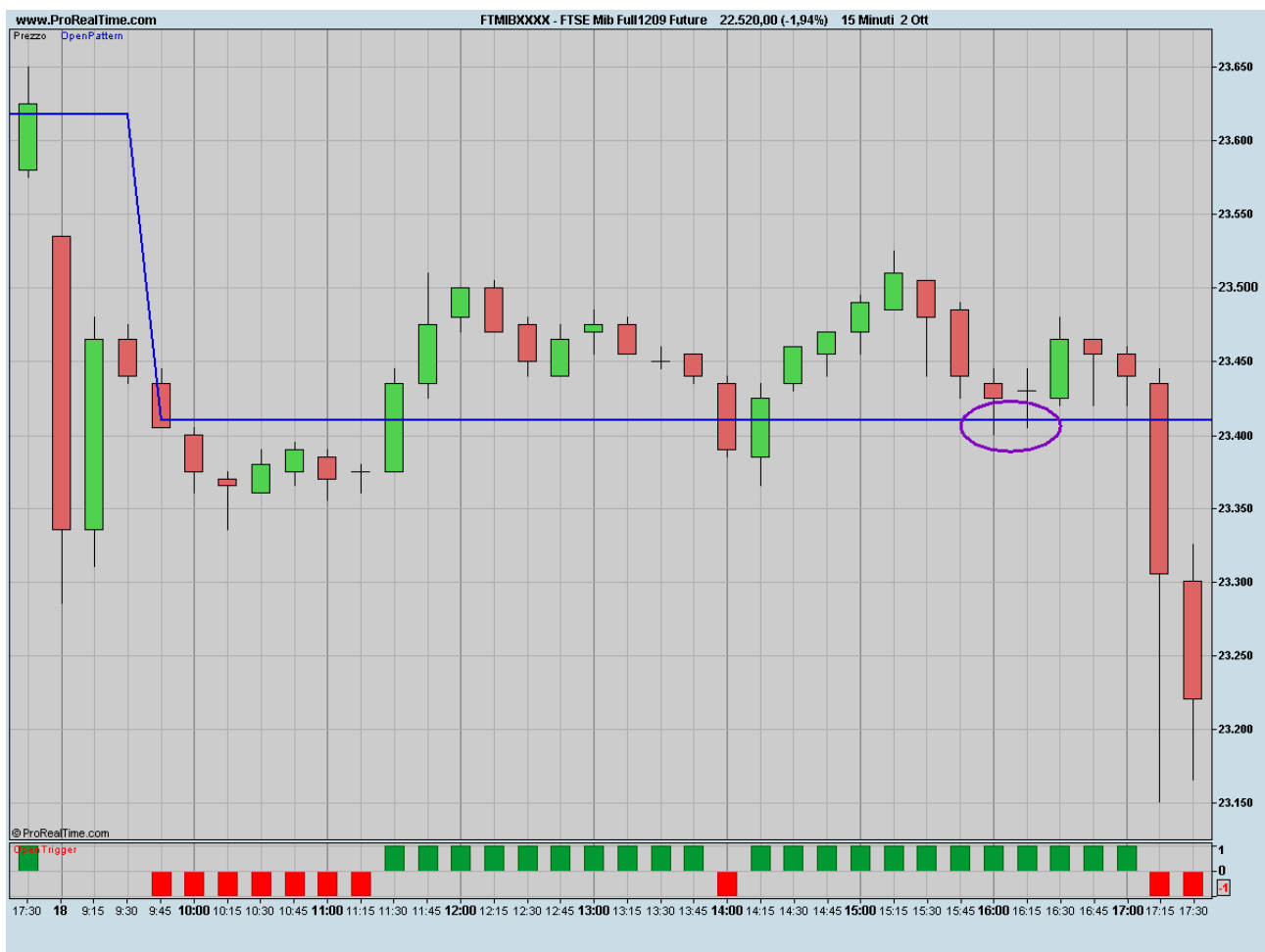
La giornata in esame ha avuto un andamento laterale con il SI che ha contenuto per due volte (vedi ellisse viola) il ribasso delle quotazioni.



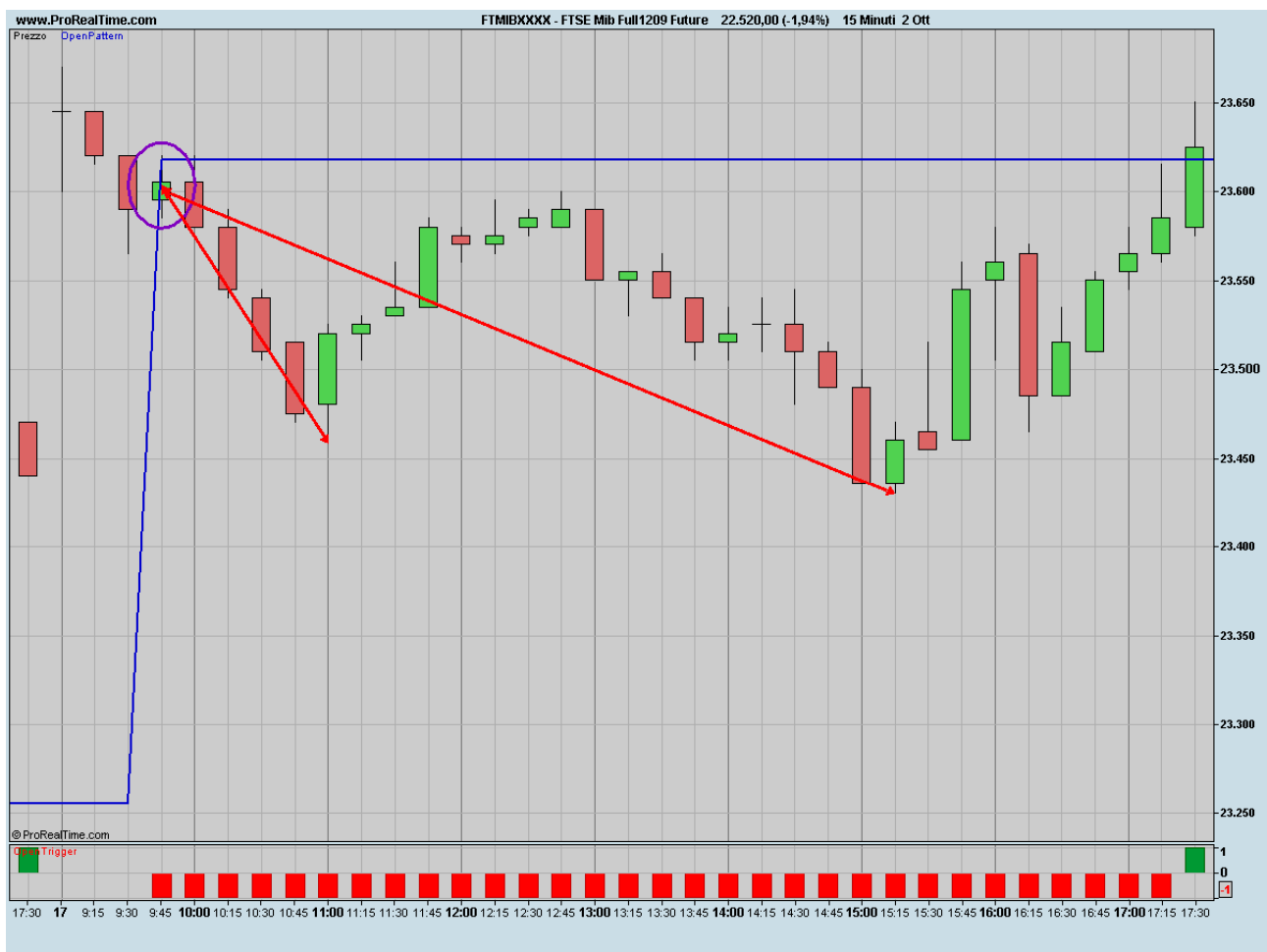
In questo caso la tendenza rialzista individuata alle 10:00 è stata messa alla prova due volte, con il SI che ha agito da supporto. Successivamente alle 15:45 la tendenza è divenuta ribassista portando le quotazioni da area 23100 in area 22900.



In questo caso la tendenza ribassista individuata alle 10:00 si è mantenuta in azione fino alle 16:30 quando c'è stata una inversione rialzista. Anche in questo caso poiché le quotazioni erano lontane dal SI, tale inversione si sarebbe potuta individuare solo con altri strumenti.

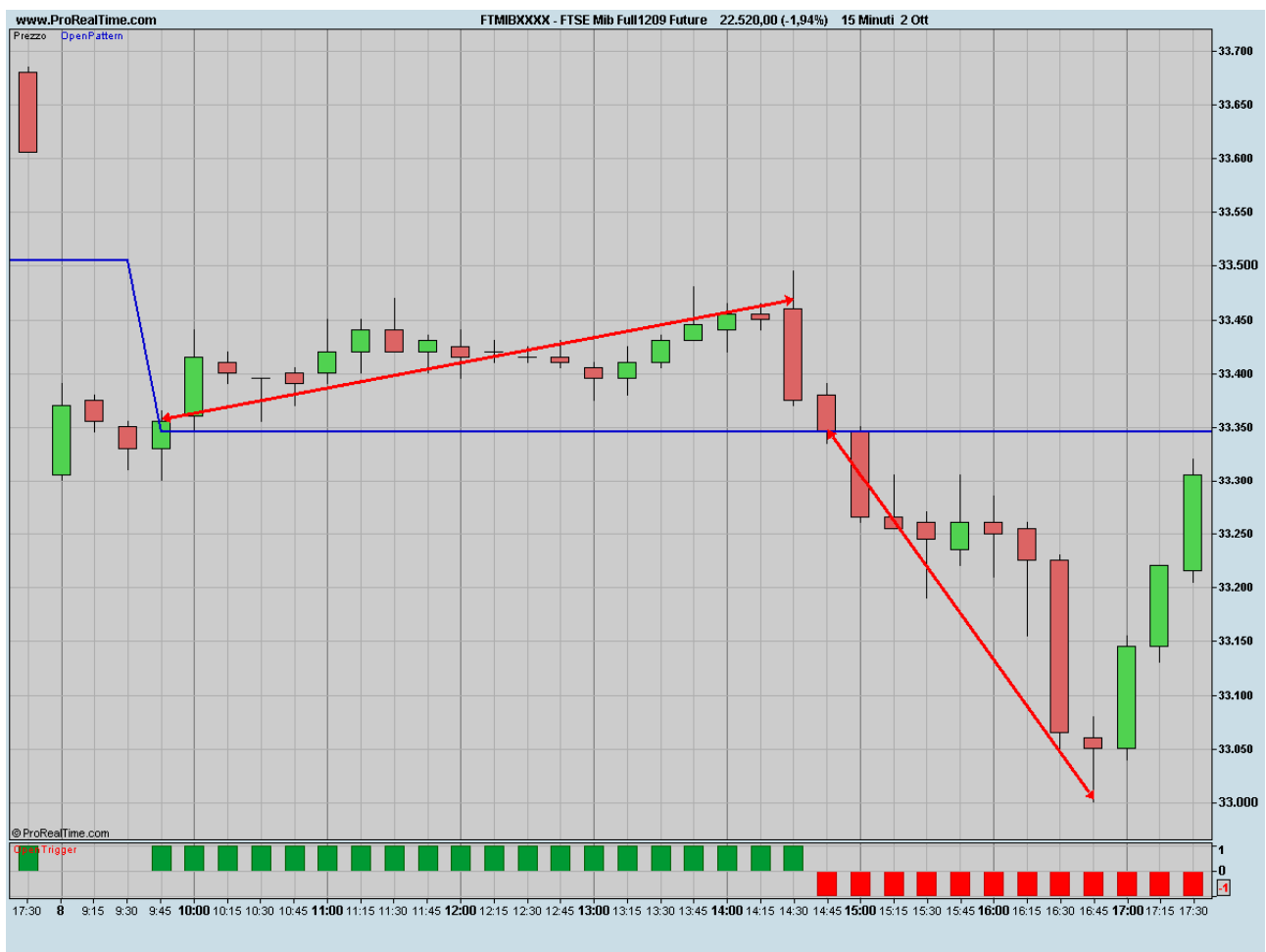


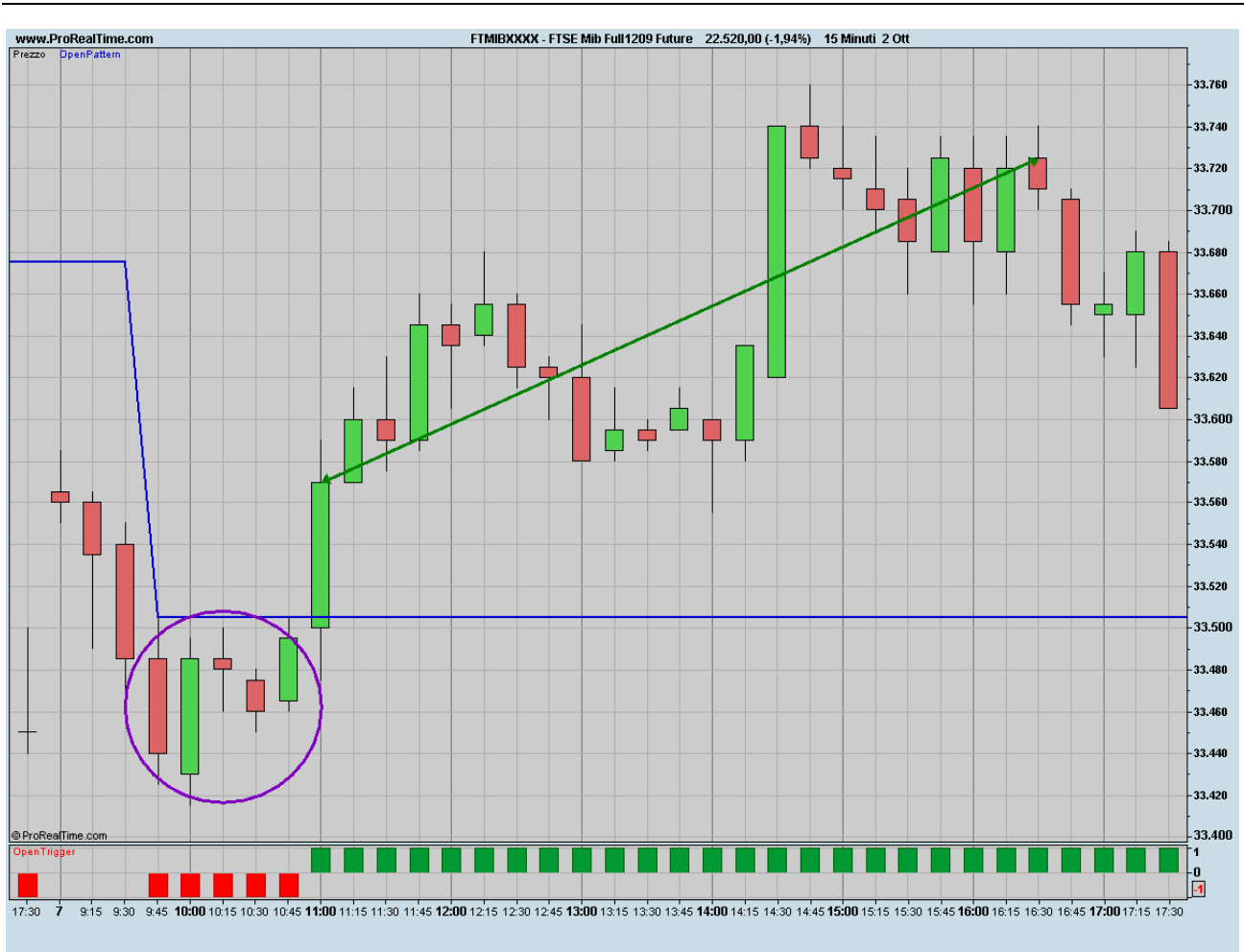
Tipica giornata laterale con le quotazioni che si muovono in un range di circa 300 punti. In questi casi l'ampiezza del movimento individuata dal SI è per forza di cose limitata.

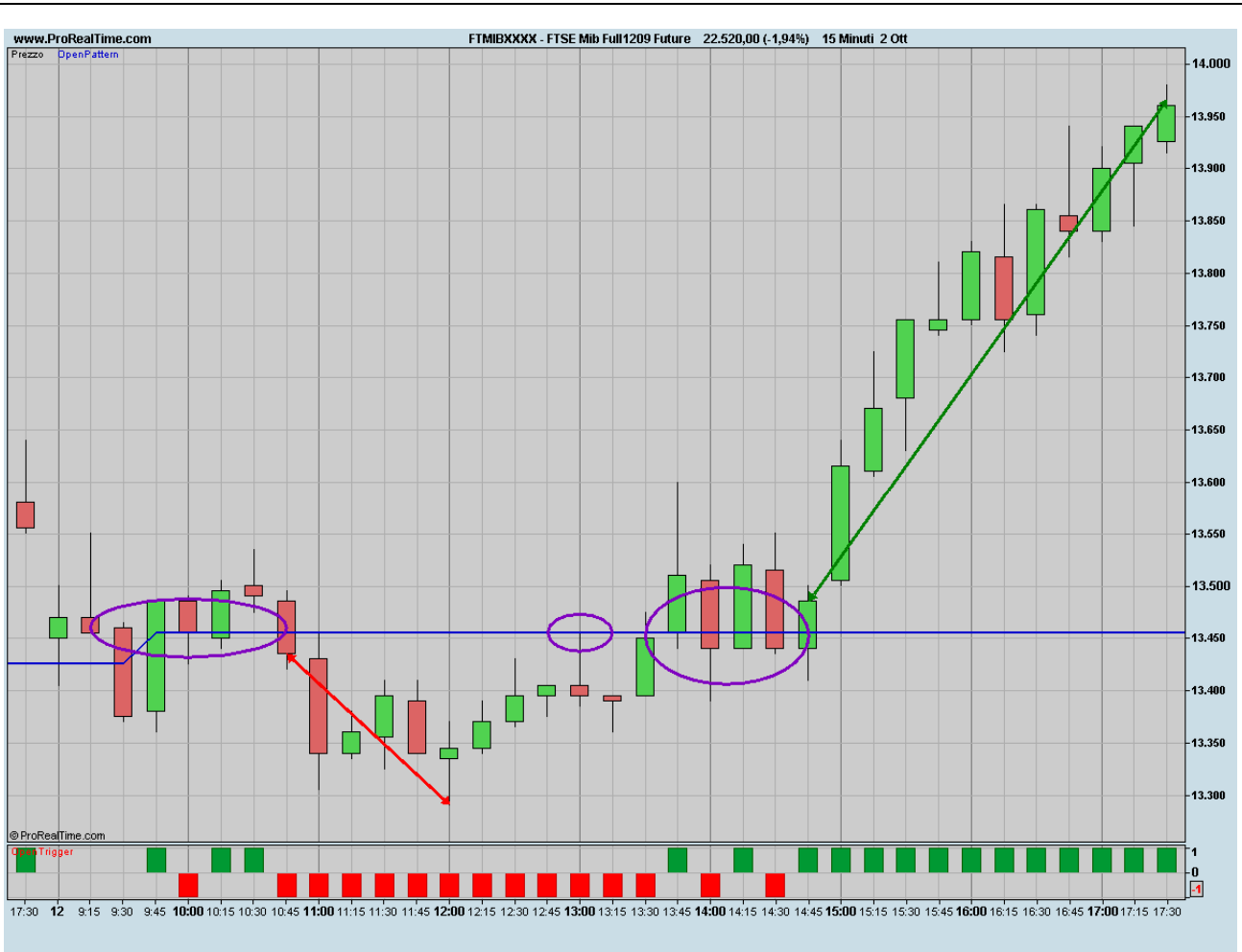


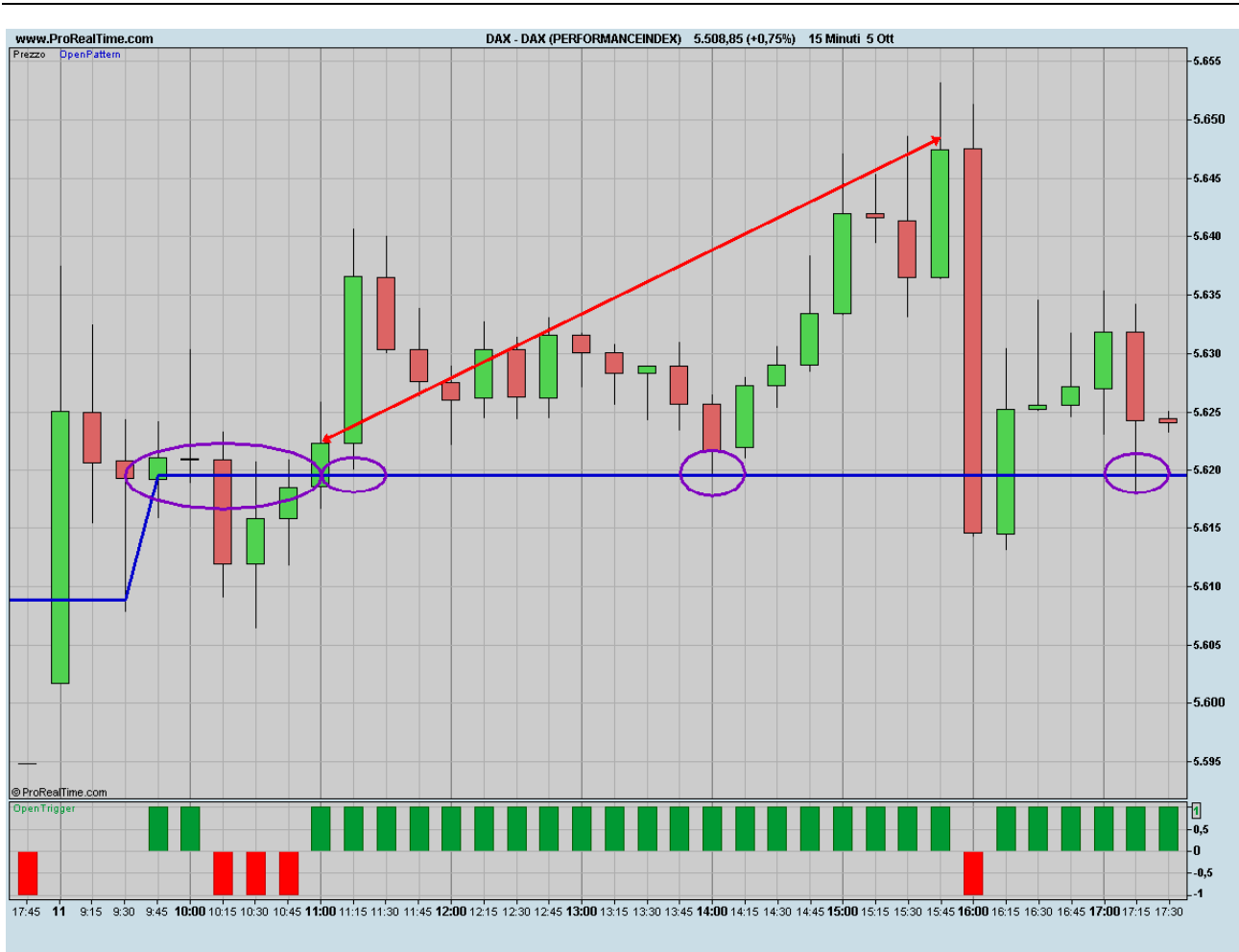
Alla chiusura delle 10:00 (la barra è indicata da un'ellisse viola) il prezzo è inferiore al SI per cui la tendenza sarebbe ribassista, ma notiamo come la chiusura sia superiore all'apertura. In questi casi la cautela è d'obbligo.

In questo caso, sebbene con quotazioni contenute in un range di circa 150 punti, la tendenza giornaliera si è mantenuta ribassista.



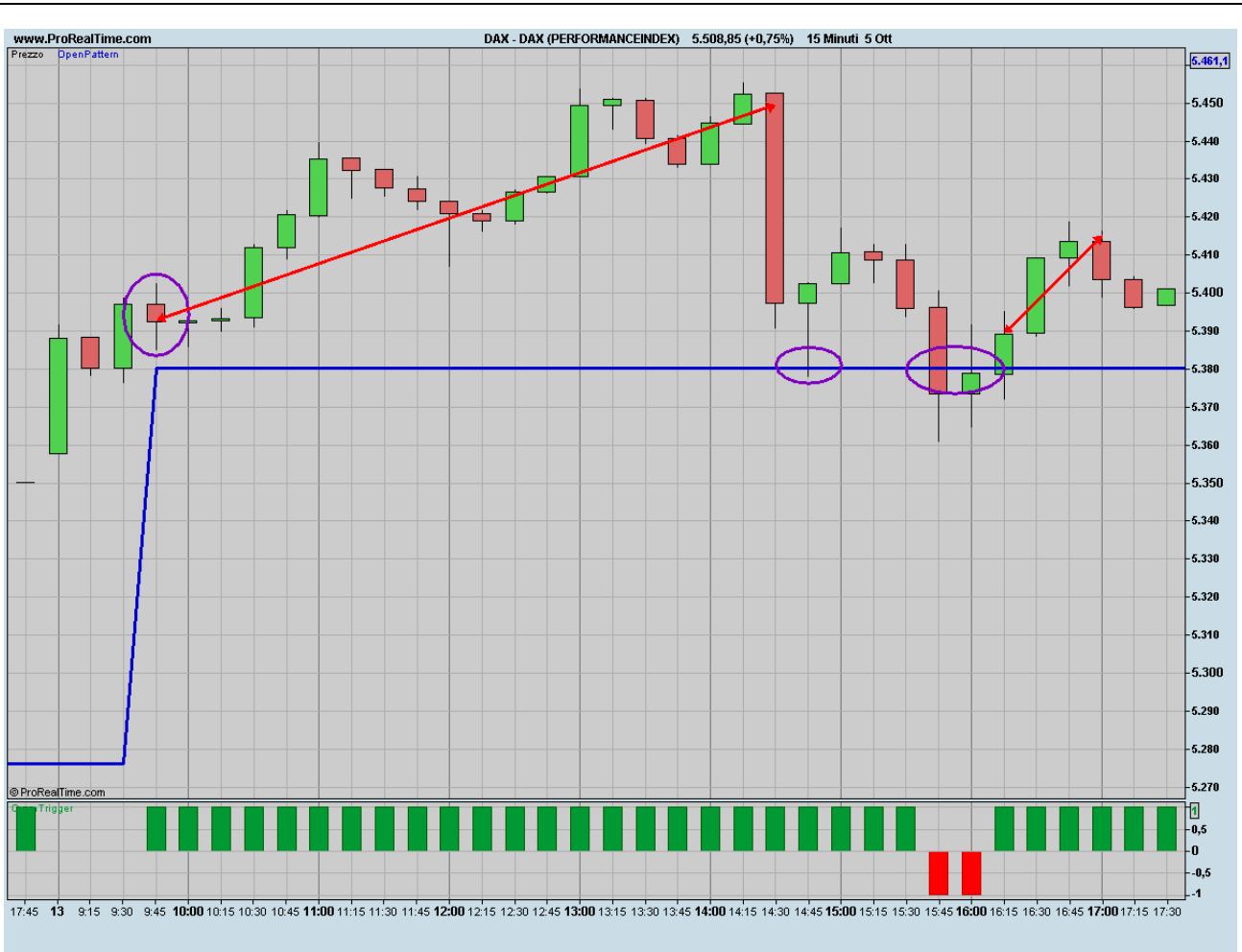


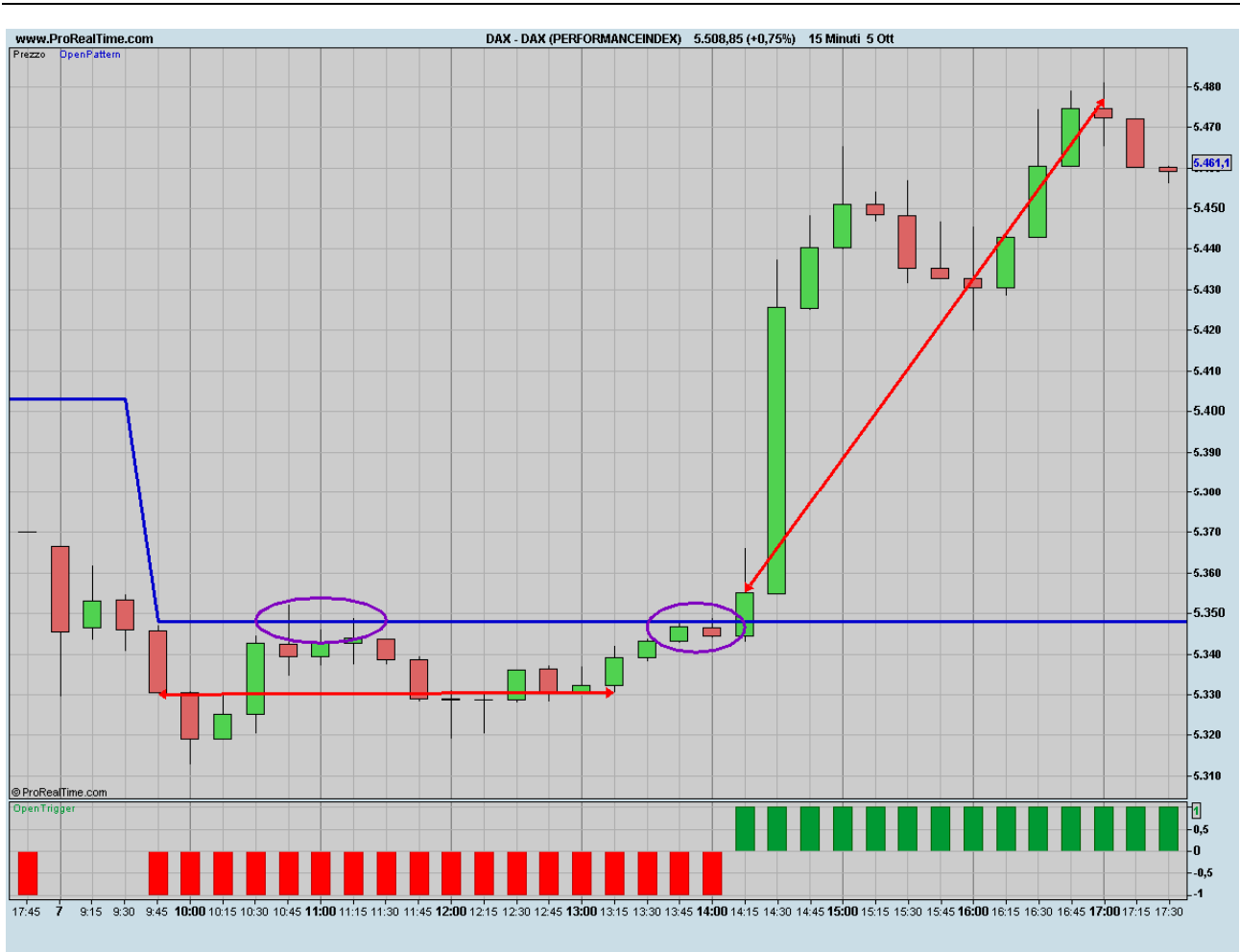


















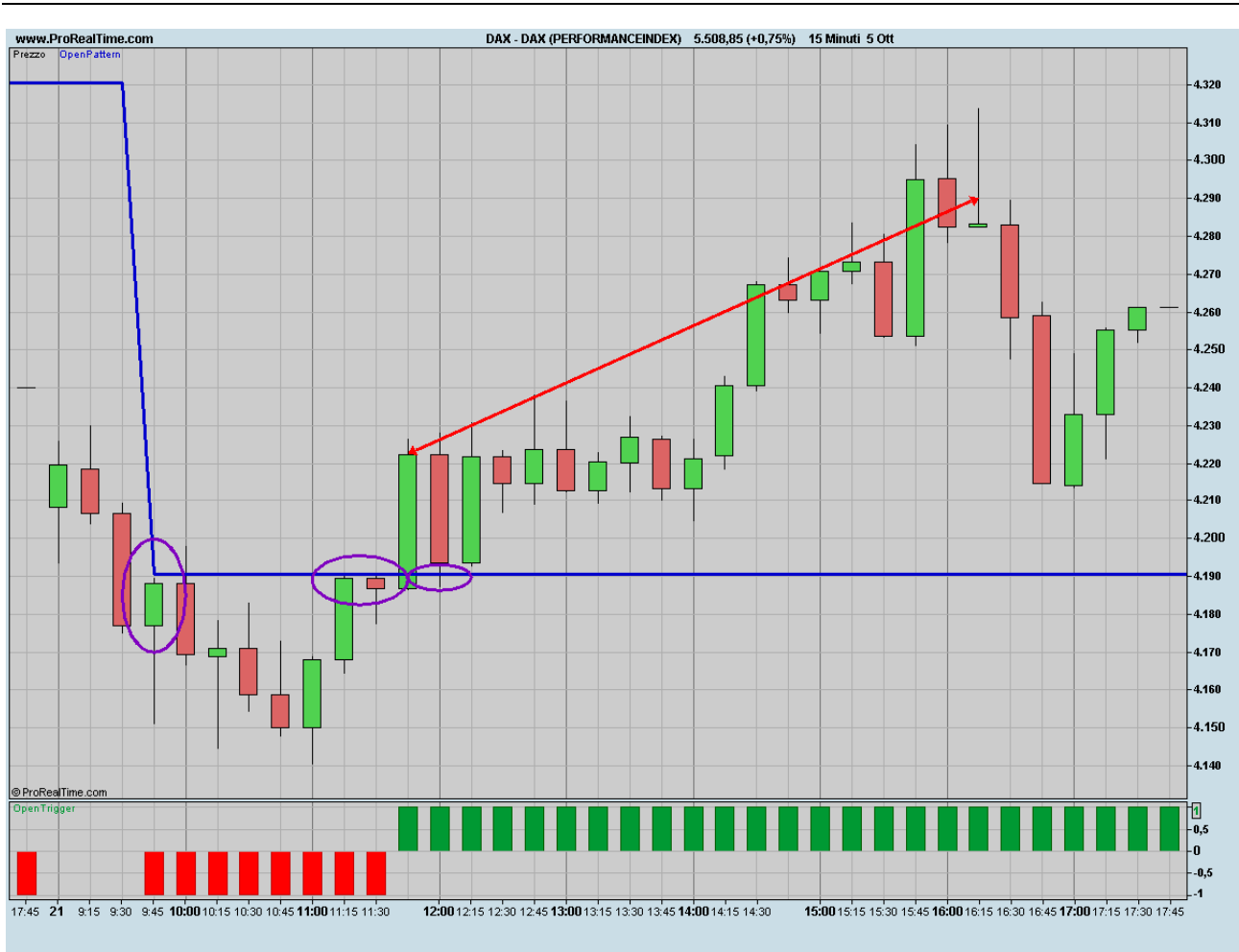


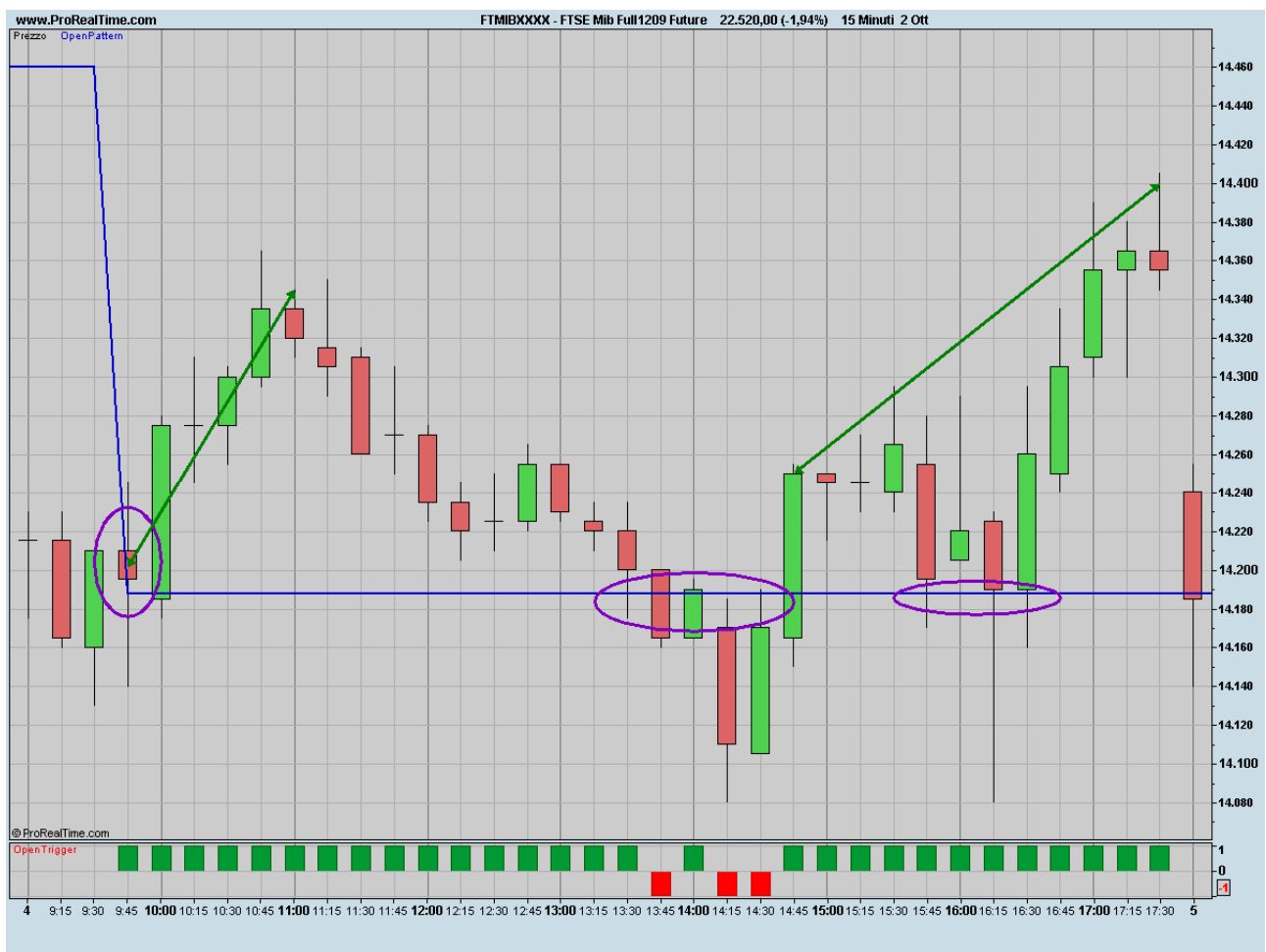


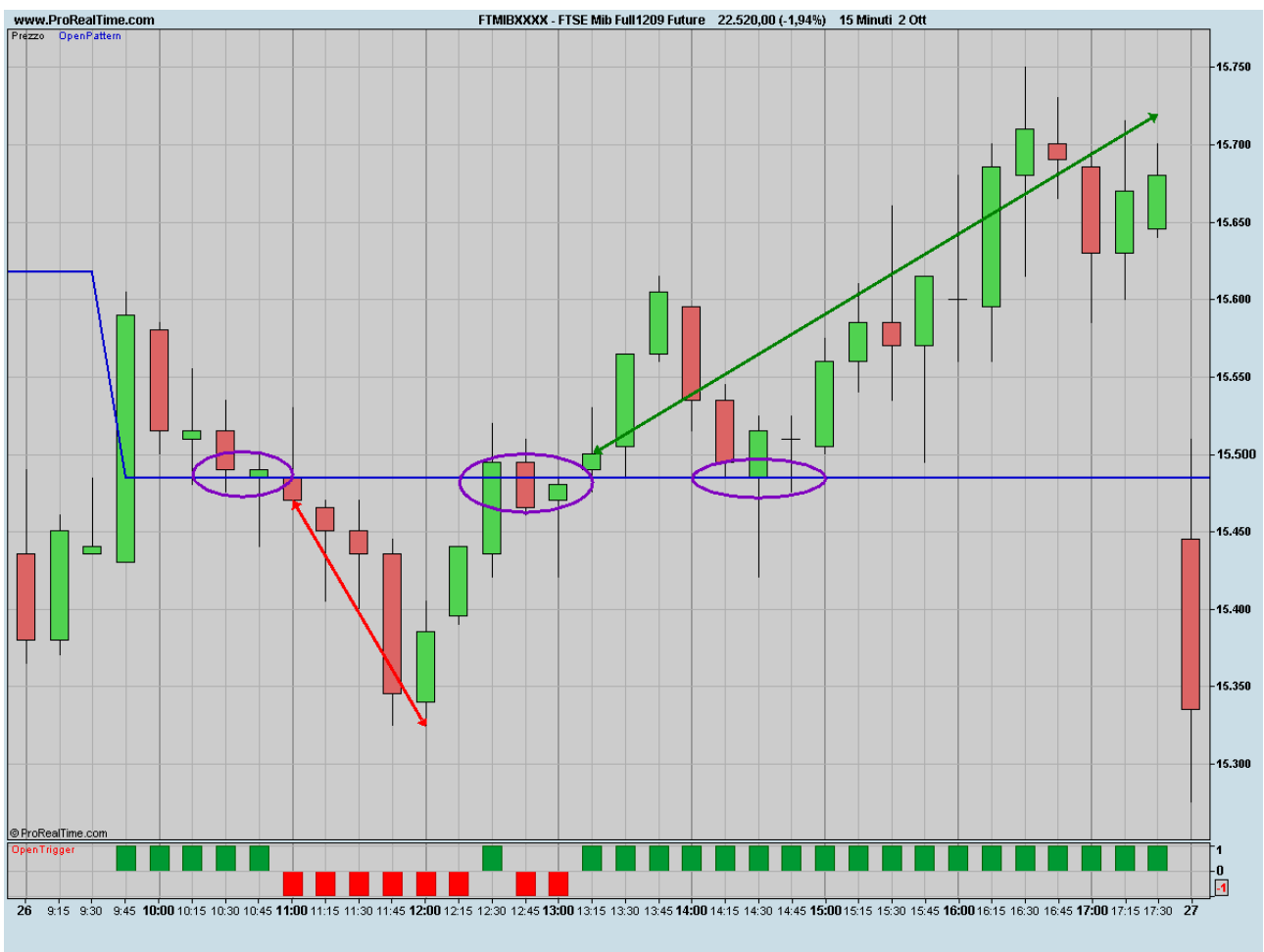


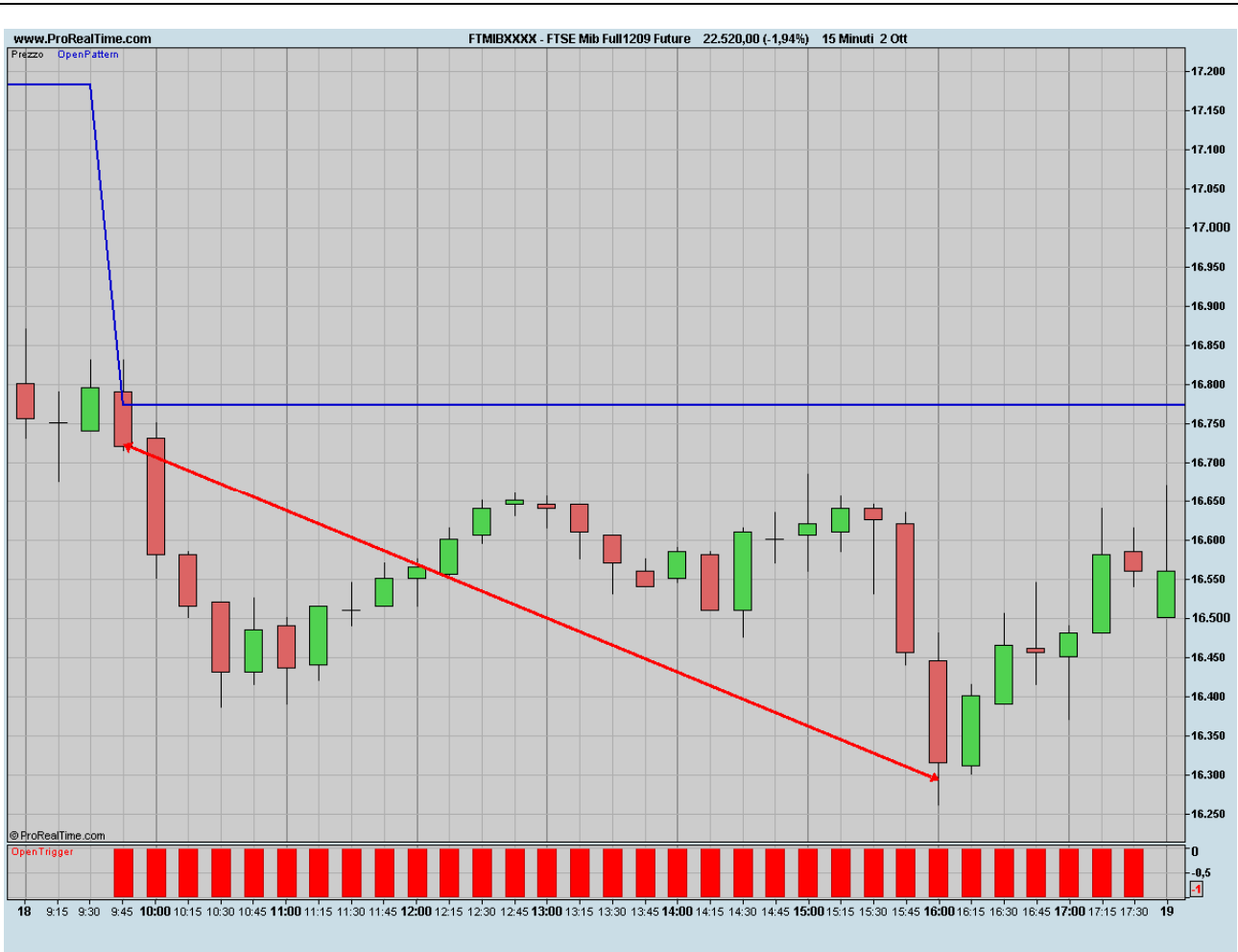


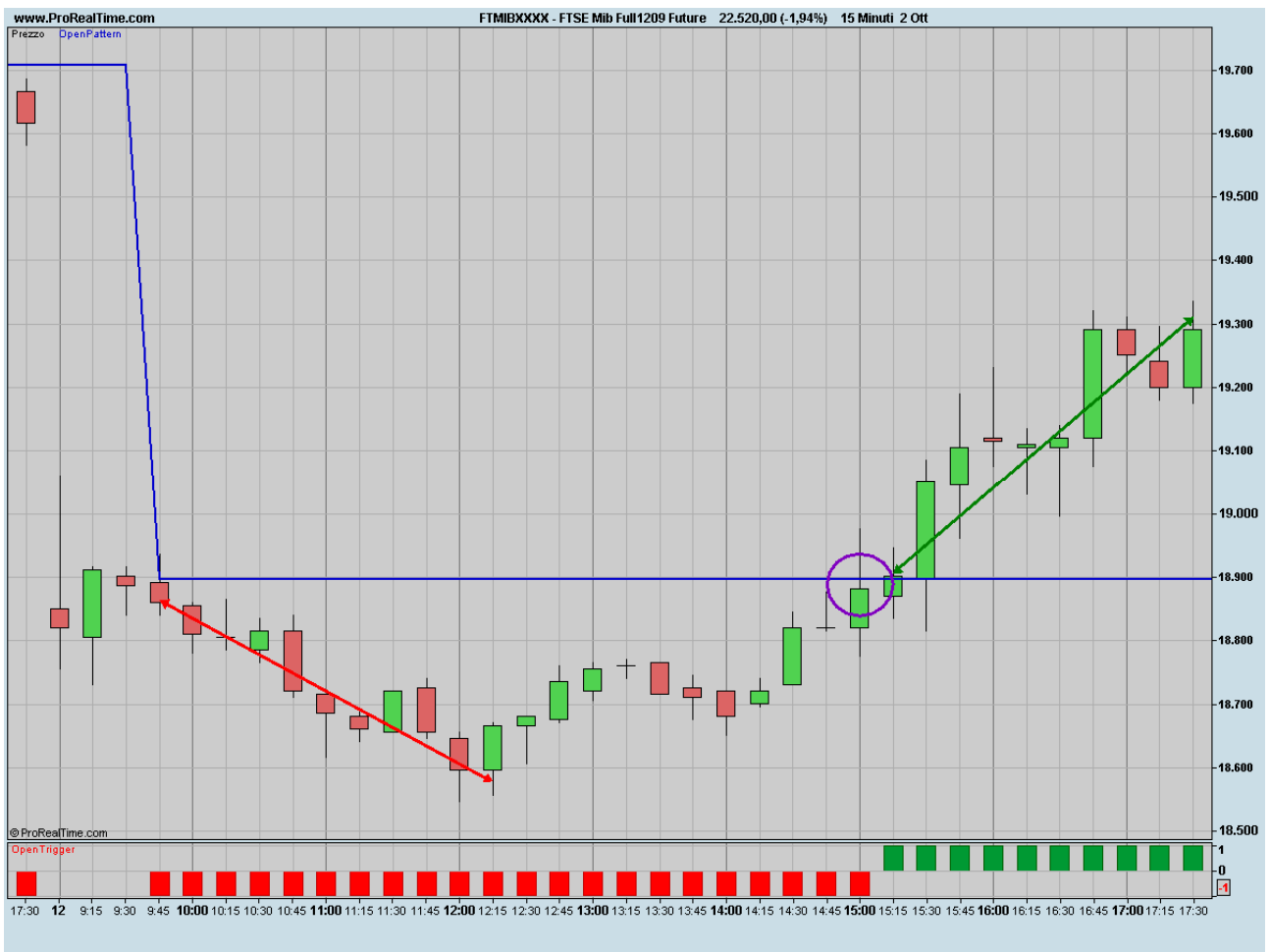


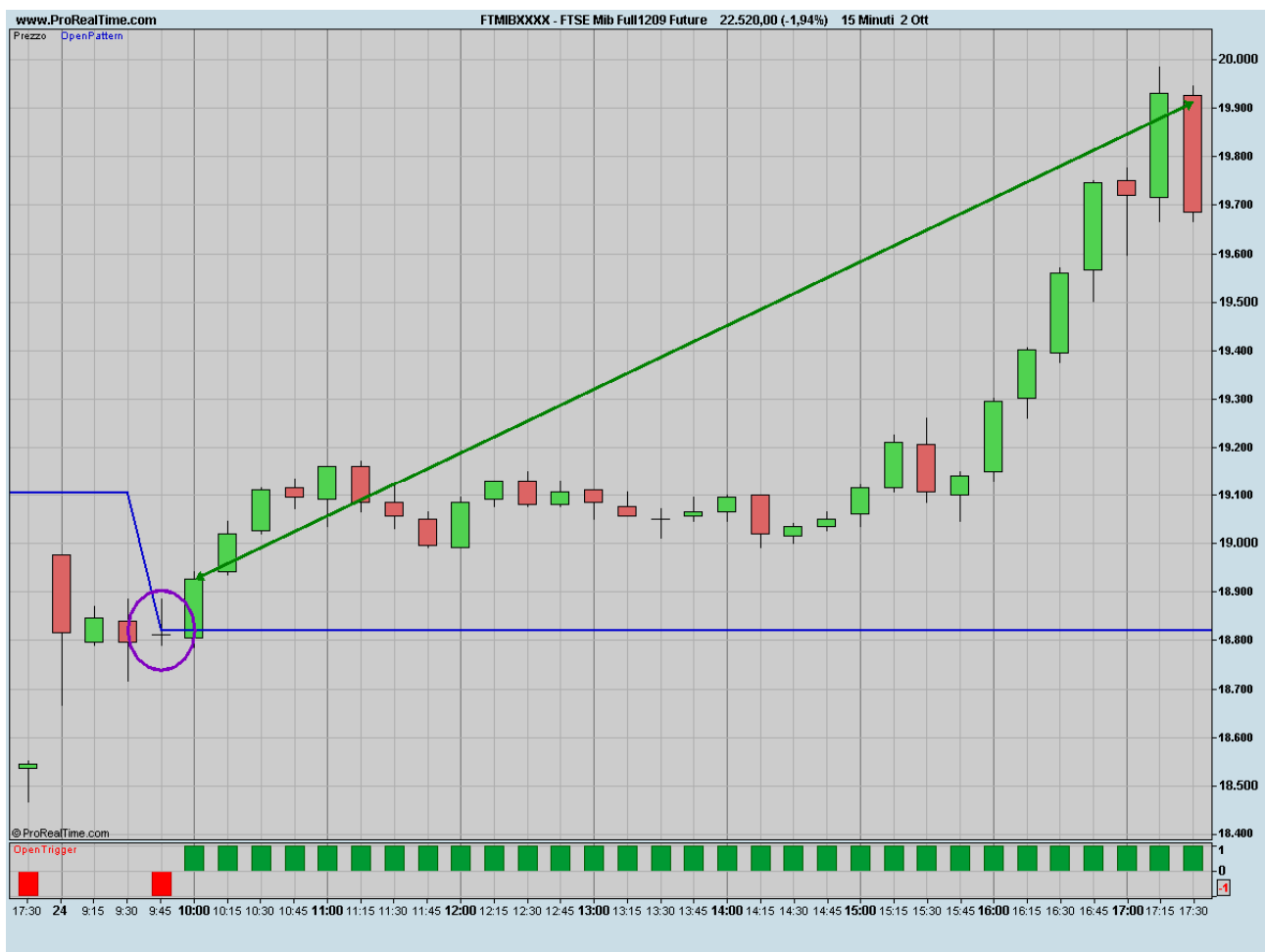


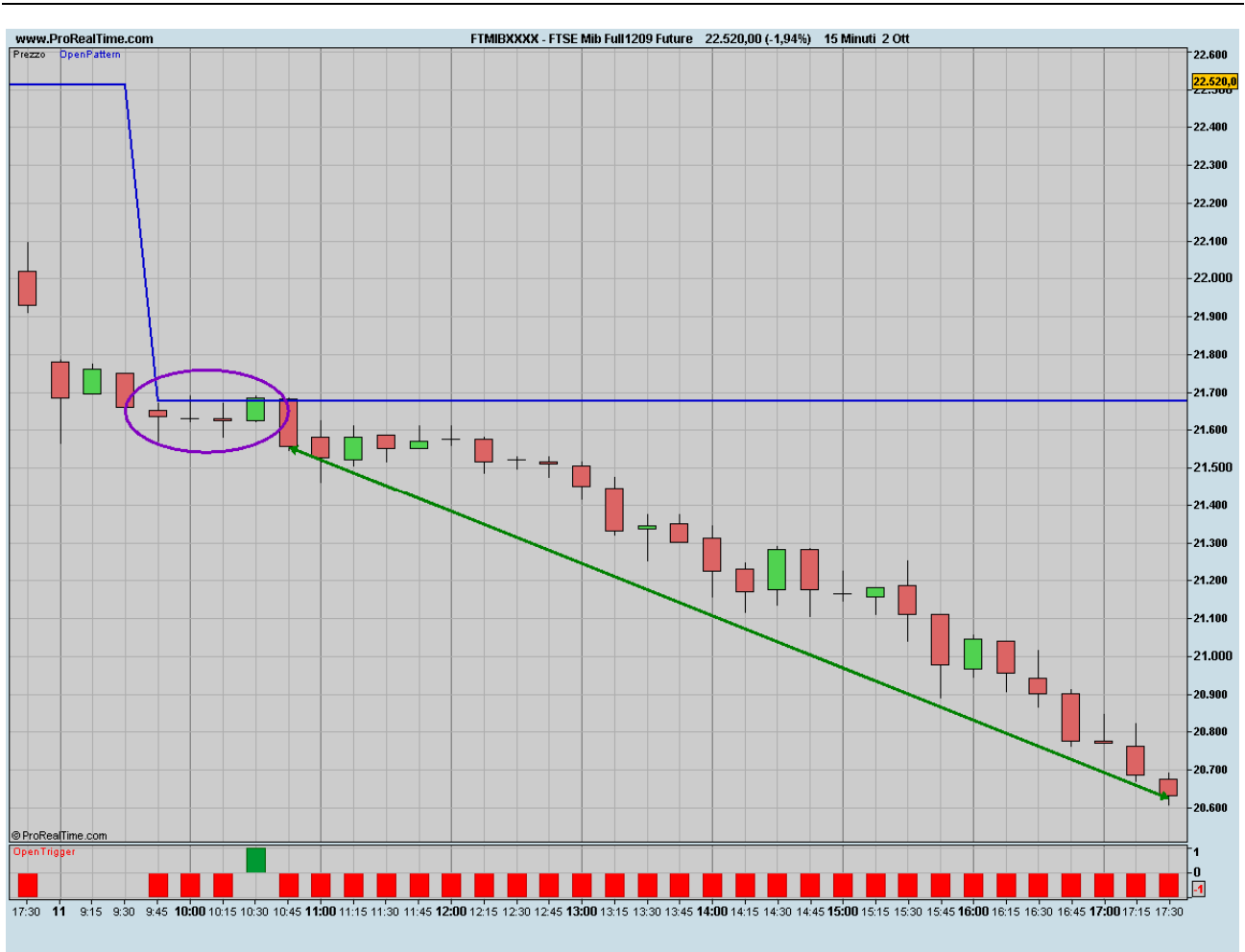




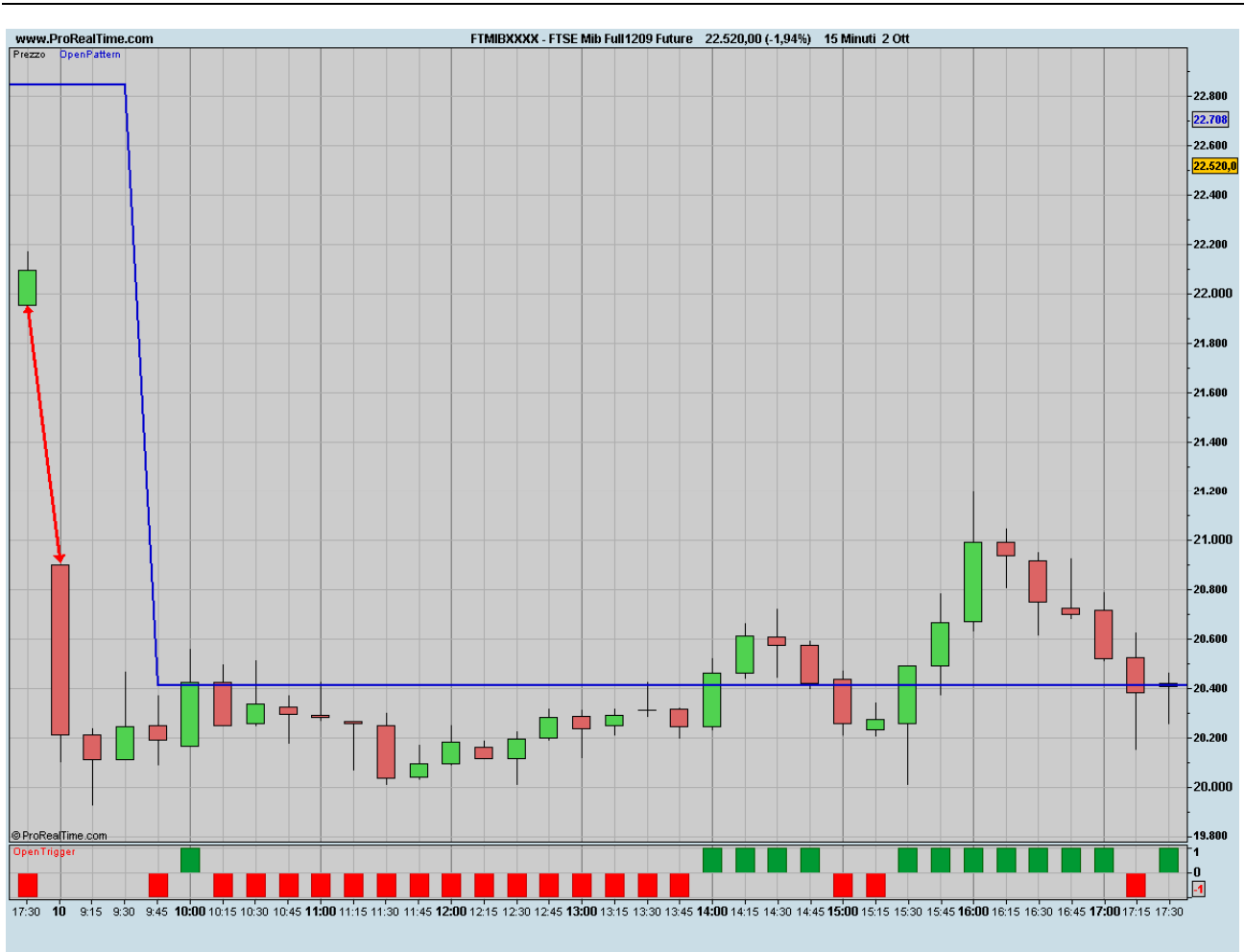






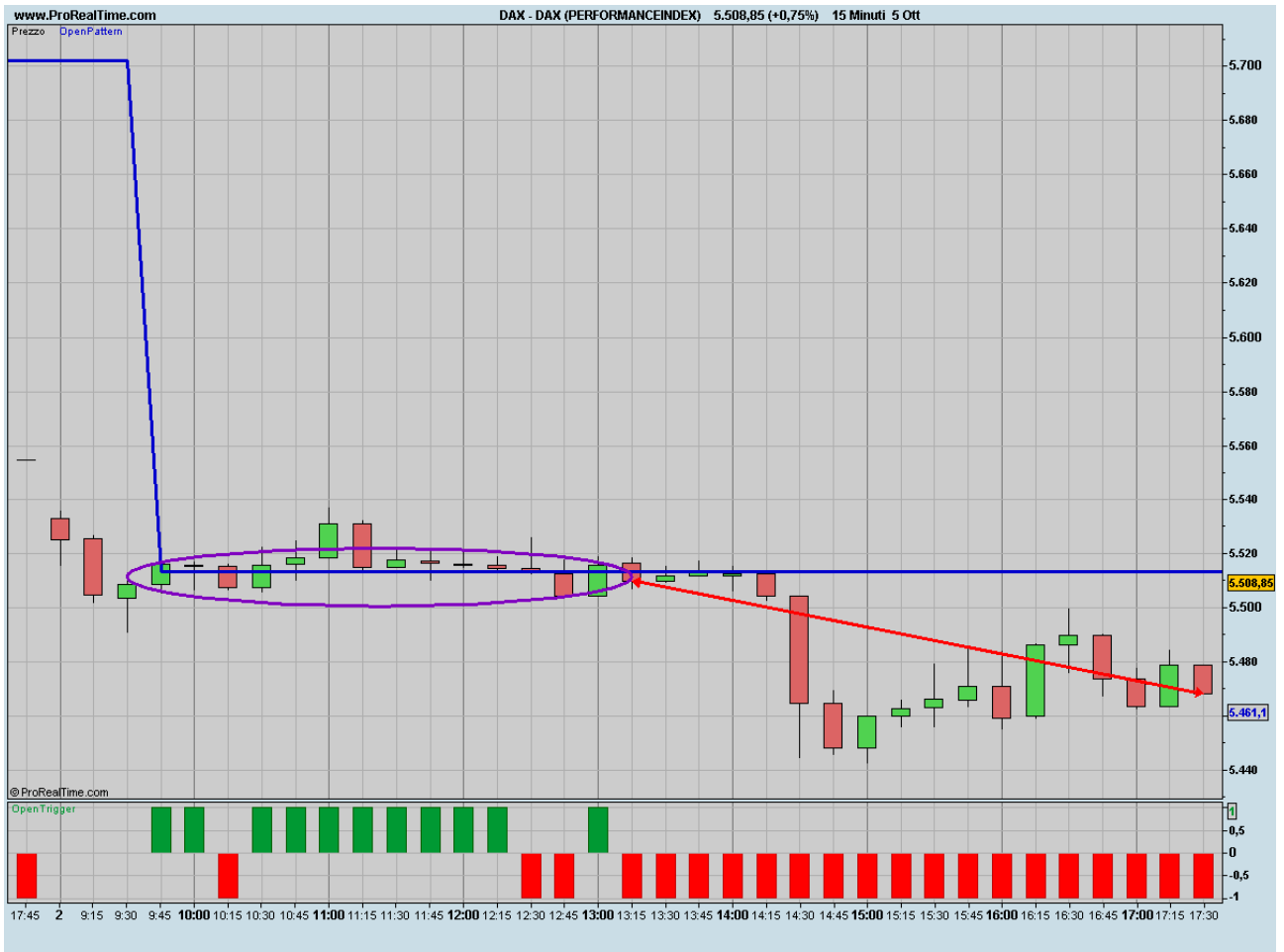




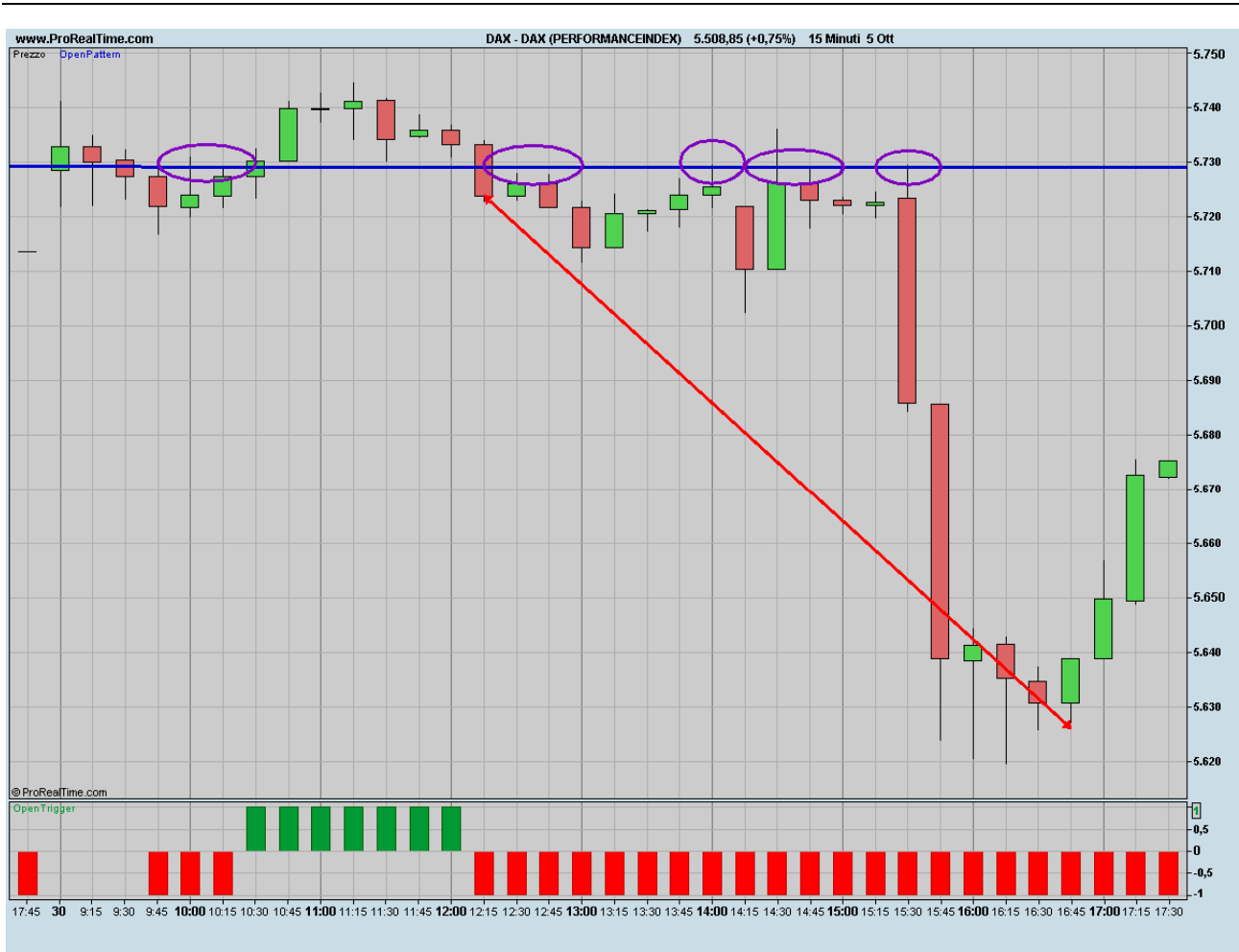




SUNRISE E IL DAX INDEX

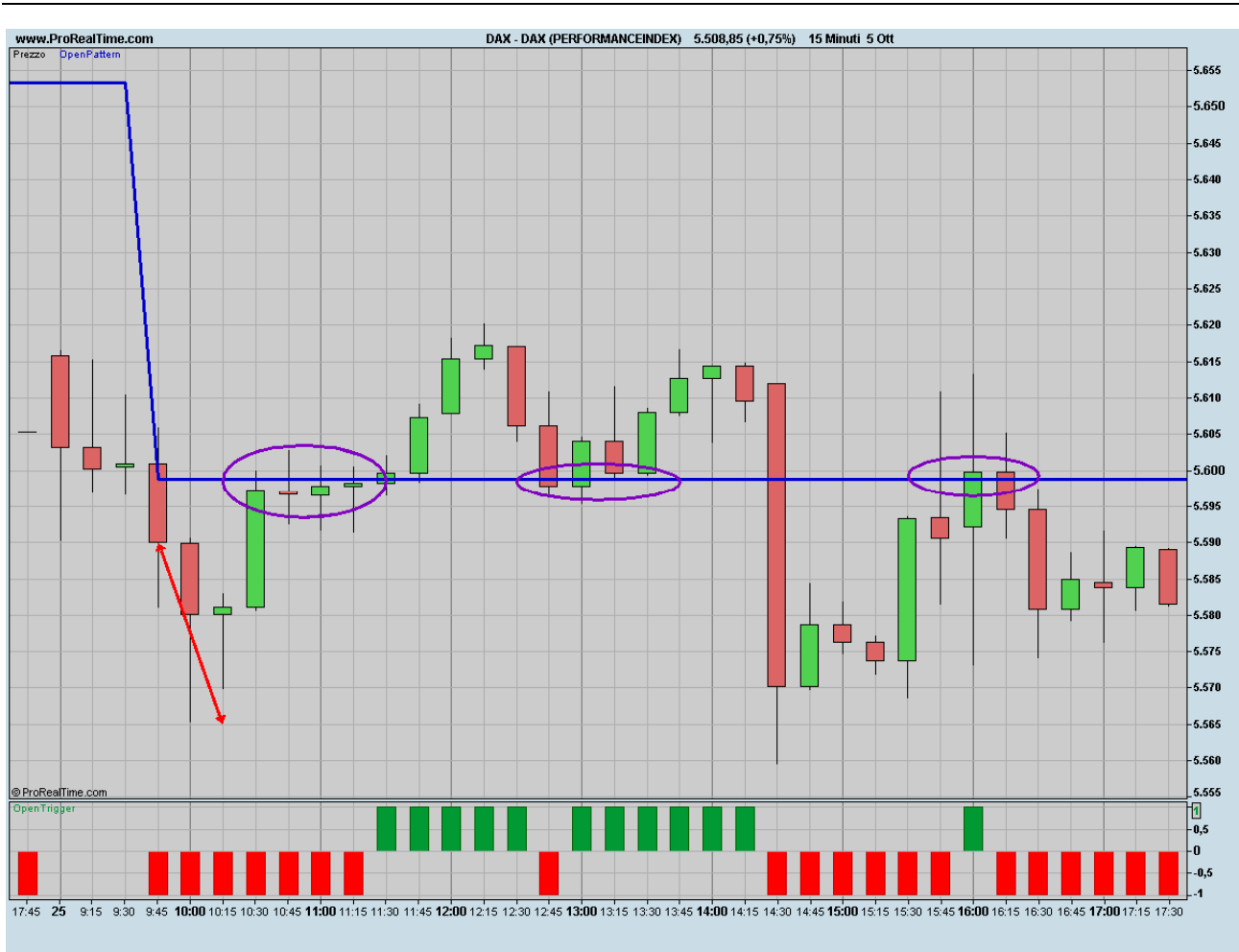




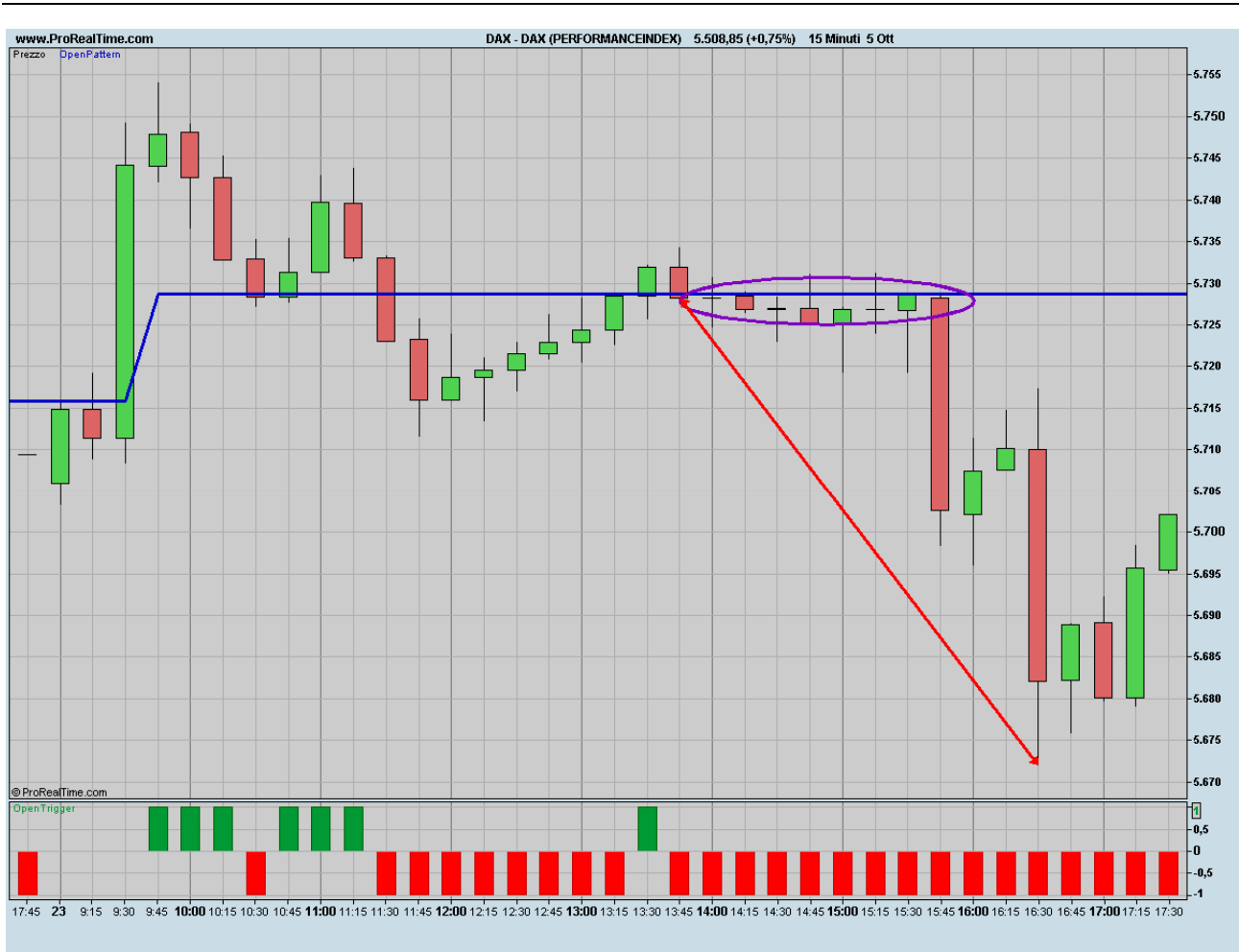


















UN TS SUL FUTURE FTSEMIB BASATO SUL SUNRISE INDICATOR

Da quanto riportato nei capitoli precedenti, dovrebbe essere chiaro che questo indicatore è fenomenale nell'individuare con elevata efficienza le fasi direzionali intraday.

Anche se il suo utilizzo per costruire un efficiente approccio ai Mercati non è lo scopo di questo ebook, vogliamo discutere un Trading System che opera sul Future FTSEMIB basato sull'utilizzo del Sunrise Indicator.

Il modo di operare è molto semplice:

1. Alle 10:00 mi calcolo il Sunrise Indicator e vado LONG (SHORT) se la chiusura è superiore (inferiore) al valore dell'indicatore;
2. Dopo essere entrato in posizione fisso il valore di Take Profit al valore di ingresso +150 (se l'operazione è LONG) oppure al valore di ingresso -150 punti (se l'operazione è SHORT);
3. Ovviamente se prima del Take Profit si ha una chiusura superiore/inferiore al Sunrise Point si fa lo Stop e Reverse e si ridefinisce il valore di Take Profit.

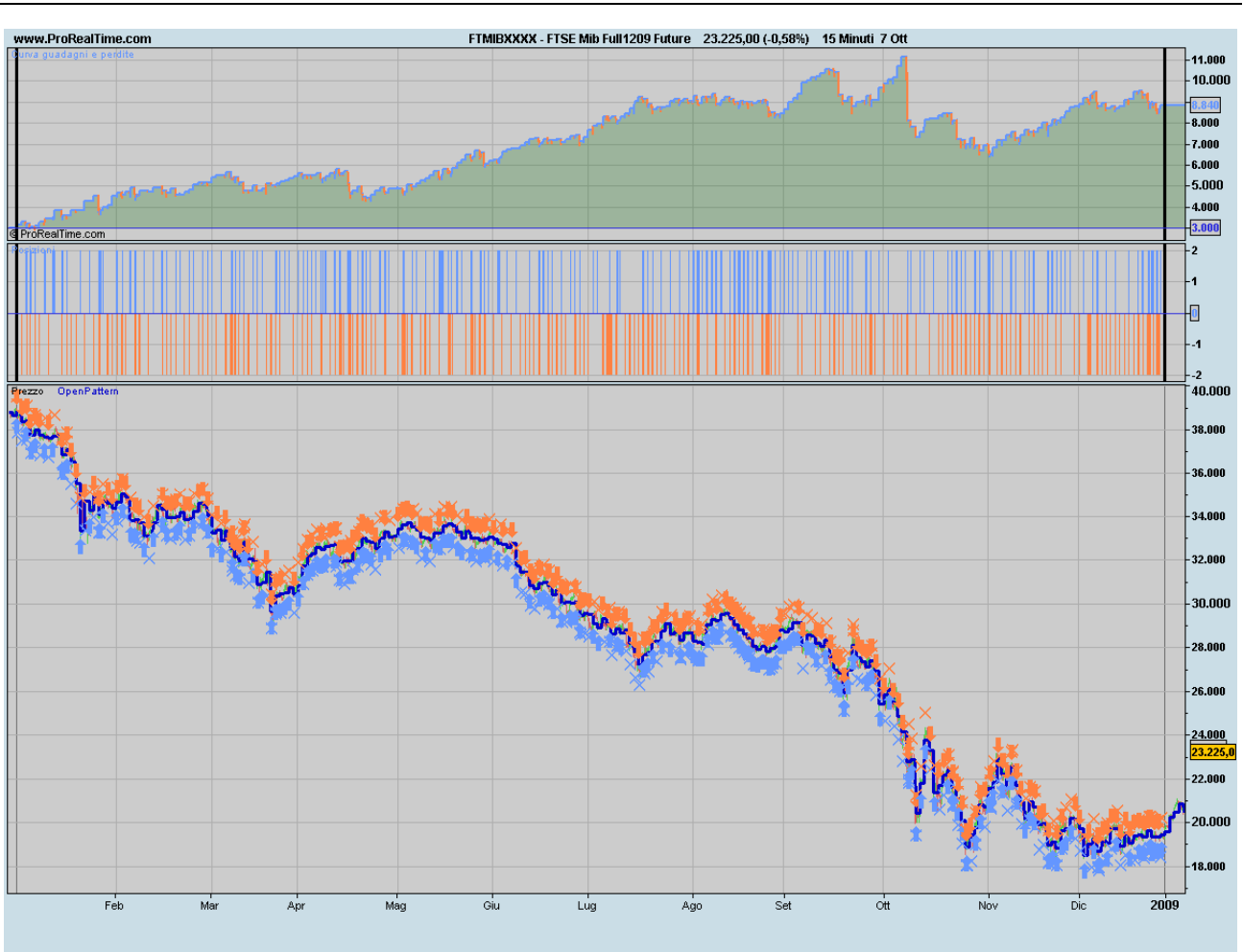
Vediamo come si è comportato questo Trading System negli anni passati.

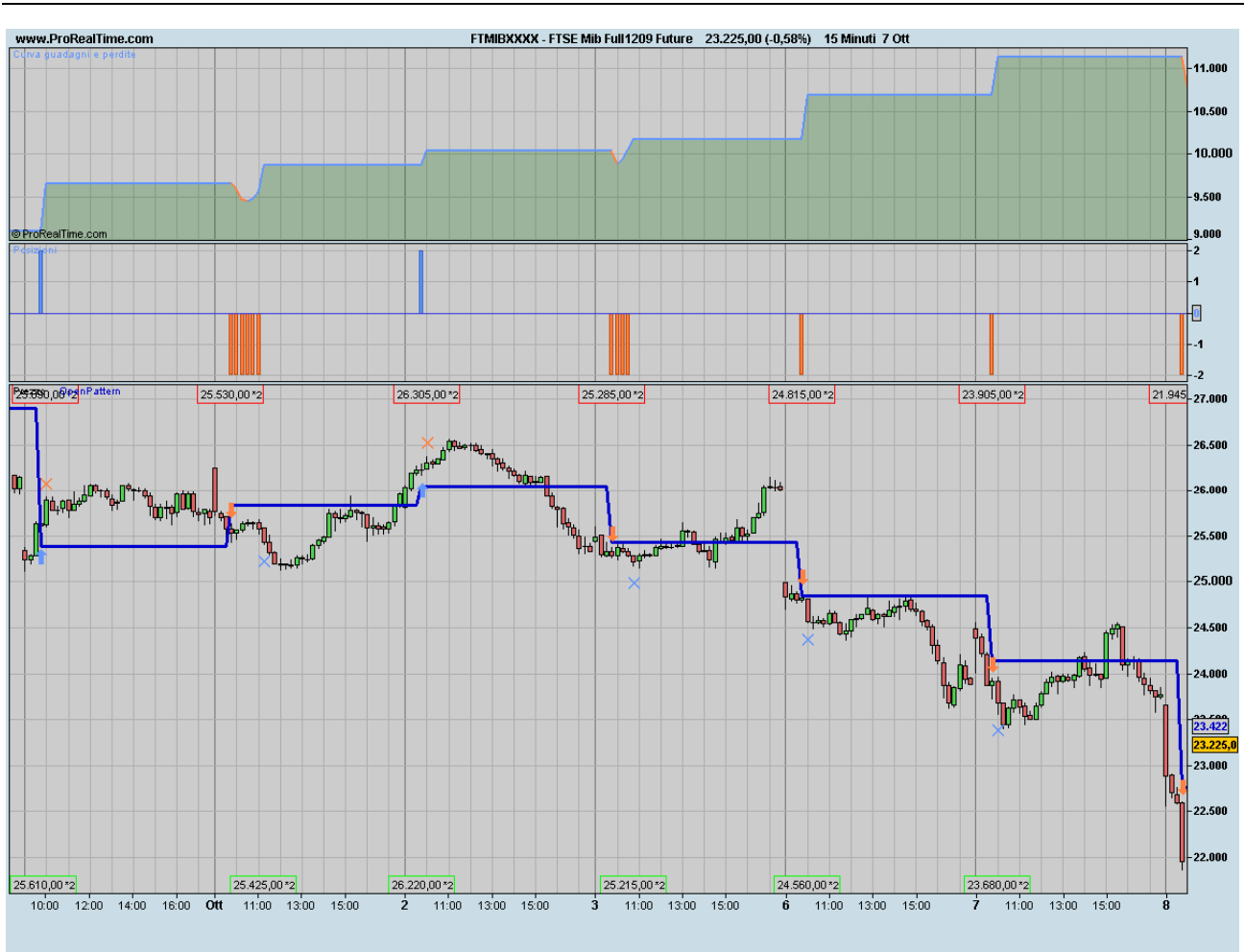
Anno 2009

Nel grafico successivo sono mostrate le statistiche relative al TS per l'anno 2009. Va notato che nella simulazione effettuata si considerano sempre 2 contratti, per cui il totale di punti realizzati dal 1 Gennaio alla chiusura del 7 Ottobre è pari a 5135.

Osserviamo che in 196 giorni di borsa aperta sono state effettuate 360 operazioni per una media giornaliera di 1,8 operazioni.

Tutti i trade	Trades long	Trades short	
10.270,00	4.660,00	5.610,00	Totale netto di profitti e perdite
31.670,00	15.760,00	15.910,00	Cumuloguardagni
-21.400,00	-11.100,00	-10.300,00	Cumulo perdite
1,48	1,42	1,54	Fattore profitto
360	186	174	Numero totale trades
52,22%	52,69%	51,72%	Trades vincenti(%)
188	98	90	Trades vincenti
168	85	83	Trades perdenti
4	3	1	Trades nulli
28,53	25,05	32,24	Profitti e perdite medi per trade
168,46	160,82	176,78	Guadagni med
-127,38	-130,59	-124,10	Perdite medie
170,12	163,66	176,69	Scarto Tipo di profitti e perdite
560,00	400,00	560,00	Maggior guadagno
-590,00	-470,00	-590,00	Maggior perdita
3,89	4,66	3,08	Durata media per trade (num di bar...
15,18	29,46	31,51	Durata media tra due trades (num ...
4,02	4,70	3,27	Durata media trades vincenti (num ...
3,80	4,73	2,86	Durata media trade perdenti (num ...
2,00	1,00	5,00	Durata media trades nulli (num di b...
20,46%	20,46%	20,46%	Tempo d'esposizione al mercato (%)
0,00	0,00	0,00	Totale spese di mediazione
6	6	5	Numero max guadagni successivi
10	9	10	Numero max perdite successive
1.490,00	4.350,00	4.160,00	Max perdita
10.470,00	2.980,00	1.790,00	Max guadagno
342,33%	155,33%	187,00%	Ritorno su capitale iniziale (Profit&...



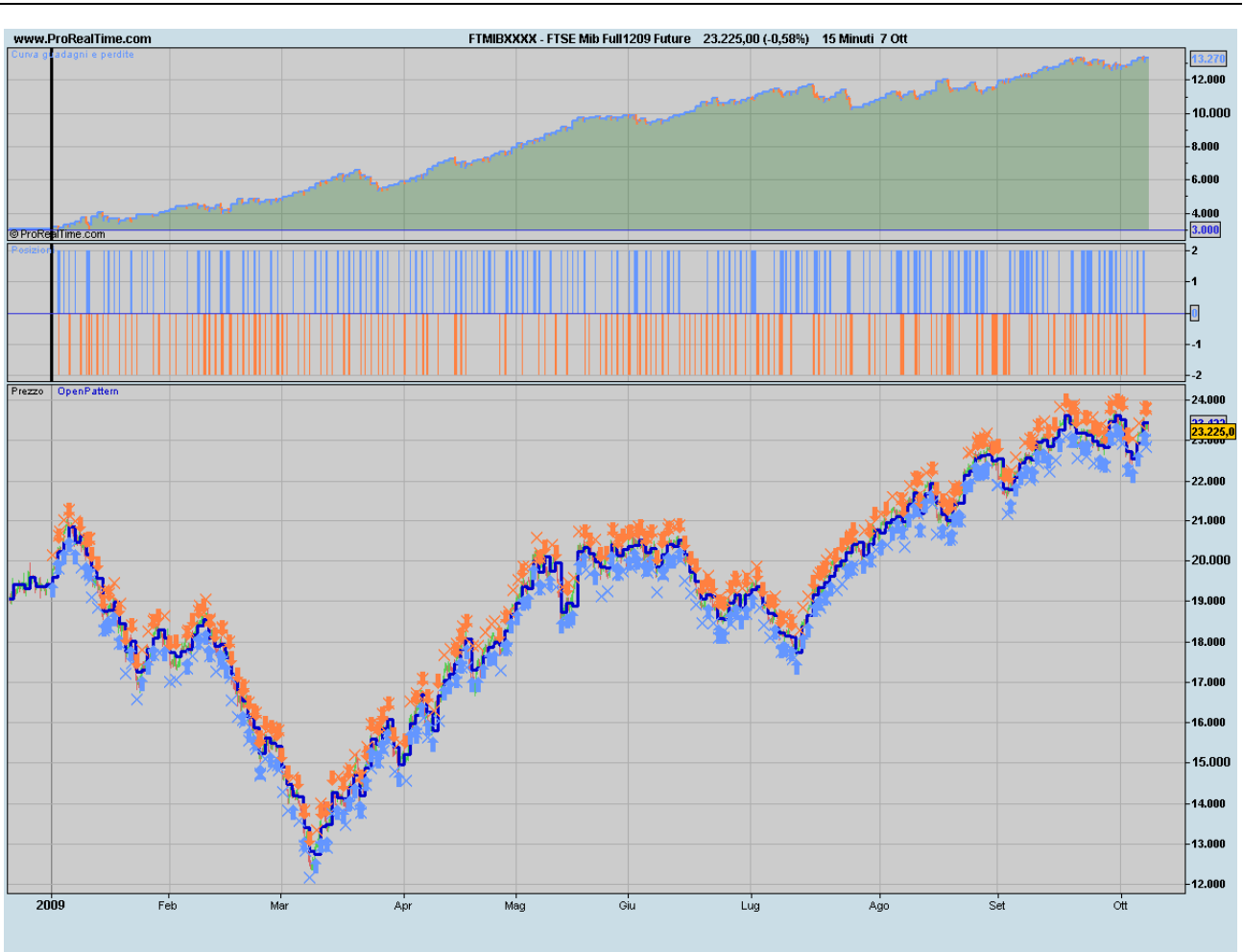


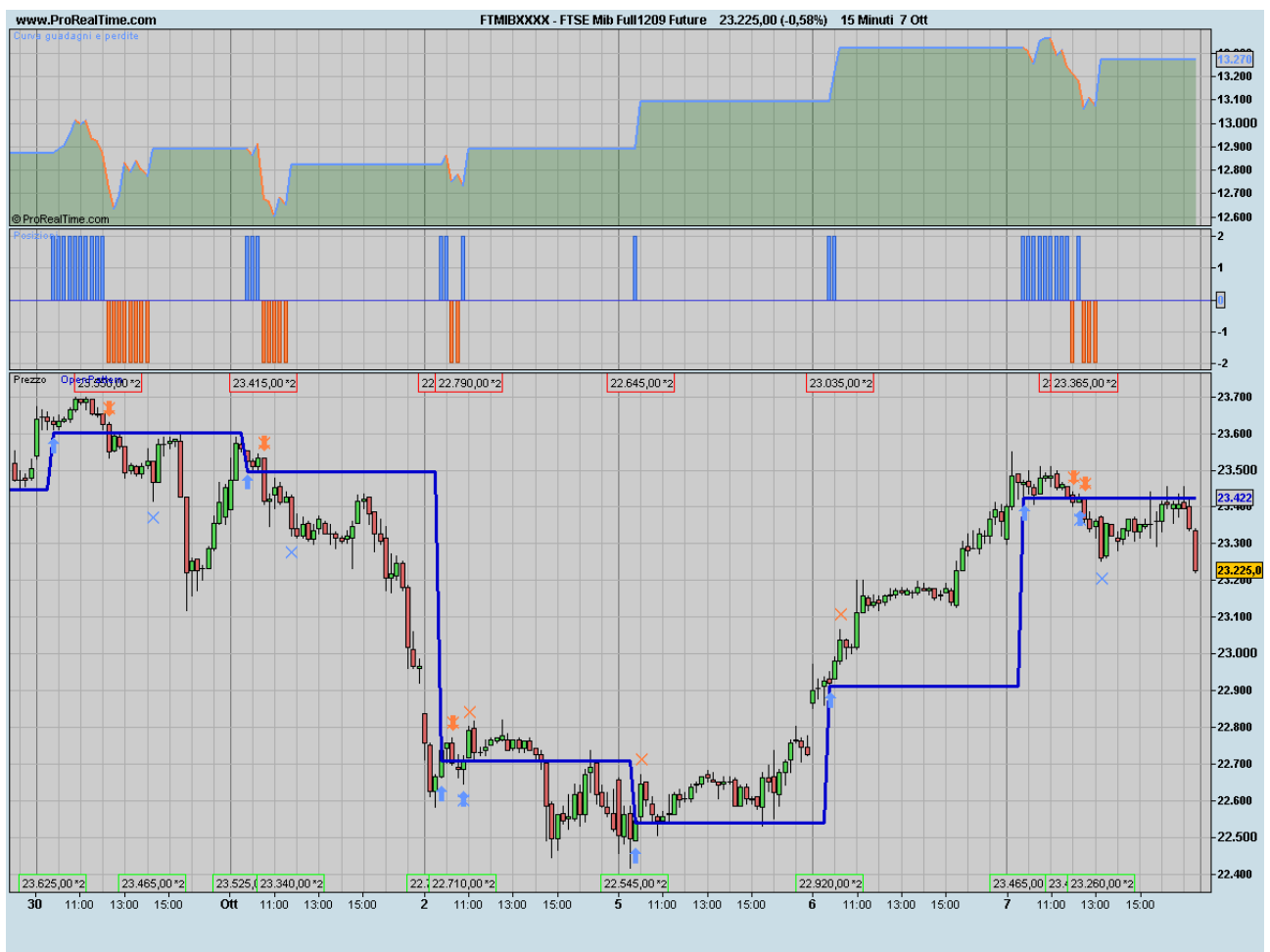
Anno 2008

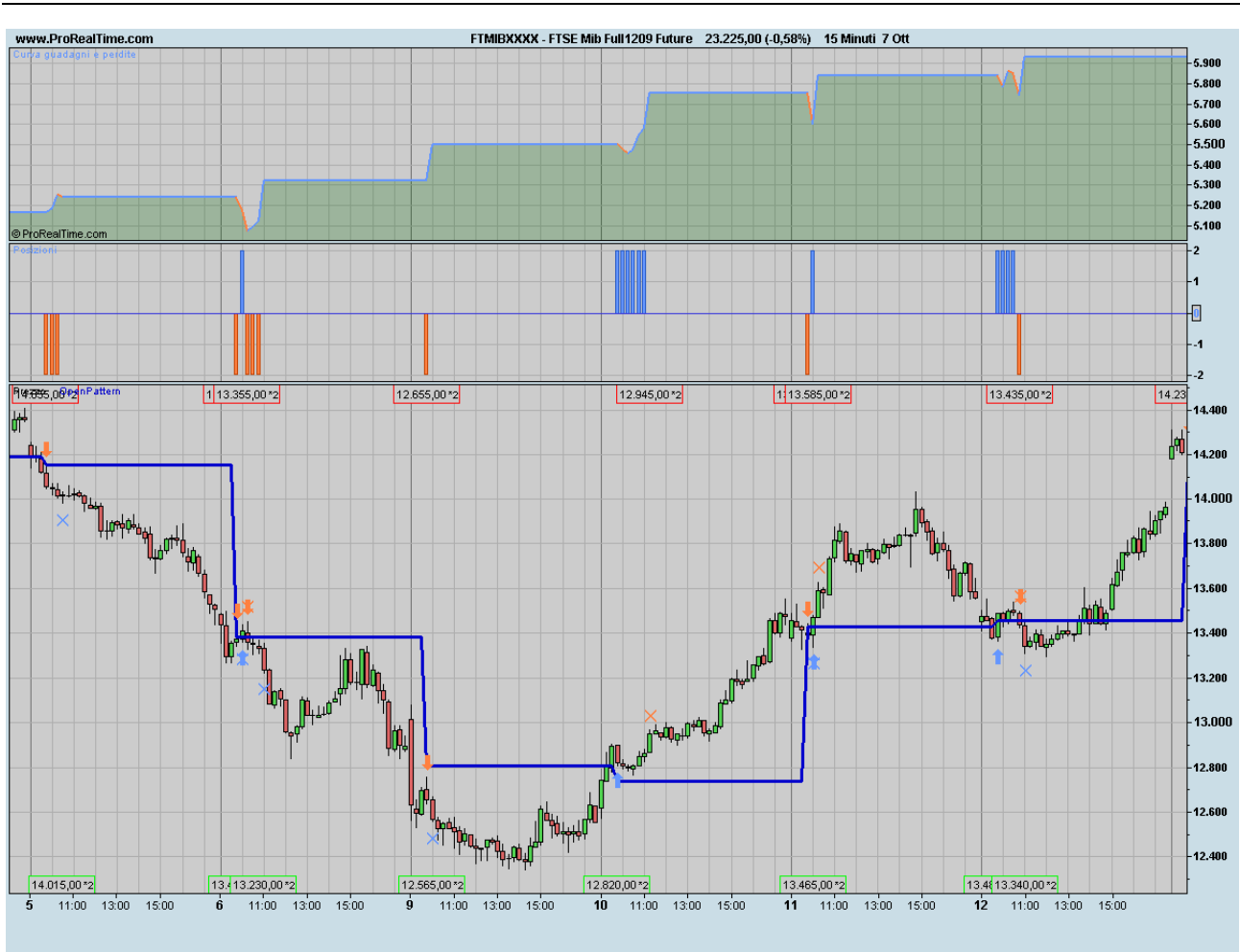
Nel grafico successivo sono mostrate le statistiche relative al TS per l'anno 2008. Va notato che nella simulazione effettuata si considerano sempre 2 contratti, per cui il totale di punti realizzati dal 1 Gennaio alla chiusura del 31 Dicembre è pari a 2920.

Osserviamo che in 252 giorni di borsa aperta sono state effettuate 474 operazioni per una media giornaliera di 1,9 operazioni.

Tutti i trade	Trades long	Trades short	
5.840,00	4.960,00	880,00	Totale netto di profitti e perdite
42.480,00	19.780,00	22.700,00	Cumuloguardagni
-36.640,00	-14.820,00	-21.820,00	Cumulo perdite
1,16	1,33	1,04	Fattore profitto
474	226	248	Numero totale trades
51,05%	51,33%	50,81%	Trades vincenti(%)
242	116	126	Trades vincenti
228	106	122	Trades perdenti
4	4	0	Trades nulli
12,32	21,95	3,55	Profitti e perdite medi per trade
175,54	170,52	180,16	Guadagni med
-160,70	-139,81	-178,85	Perdite medie
214,36	182,57	239,34	Scarto Tipo di profitti e perdite
570,00	560,00	570,00	Maggior guadagno
-1.810,00	-790,00	-1.810,00	Maggior perdita
2,70	2,61	2,79	Durata media per trade (num di bar...
16,01	33,66	30,66	Durata media tra due trades (num ...
2,71	2,94	2,50	Durata media trades vincenti (num ...
2,74	2,33	3,09	Durata media trade perdenti (num ...
0,50	0,50	n/d	Durata media trades nulli (num di b...
14,48%	14,48%	14,48%	Tempo d'esposizione al mercato (%)
0,00	0,00	0,00	Totale spese di mediazione
8	8	8	Numero max guadagni successivi
7	7	6	Numero max perdite successive
4.750,00	9.990,00	12.740,00	Max perdita
8.300,00	1.710,00	1.950,00	Max guadagno
194,67%	165,33%	29,33%	Ritorno su capitale iniziale (Profit&...







Anno 2007

Nel grafico successivo sono mostrate le statistiche relative al TS per l'anno 2007. Va notato che nella simulazione effettuata si considerano sempre 2 contratti, per cui il totale di punti realizzati dal 1 Gennaio alla chiusura del 31 Dicembre è pari a 2685.

Osserviamo che in 252 giorni di borsa aperta sono state effettuate 552 operazioni per una media giornaliera di 2,2 operazioni.

IL SUNRISE INDICATOR APPLICATO AL TIME FRAME SETTIMANALE

Nel caso del time frame settimanale abbiamo osservato che il SI va calcolato utilizzando le quotazioni OMISSIS e la barra da osservare per seguire il movimento dei prezzi è quella oraria.

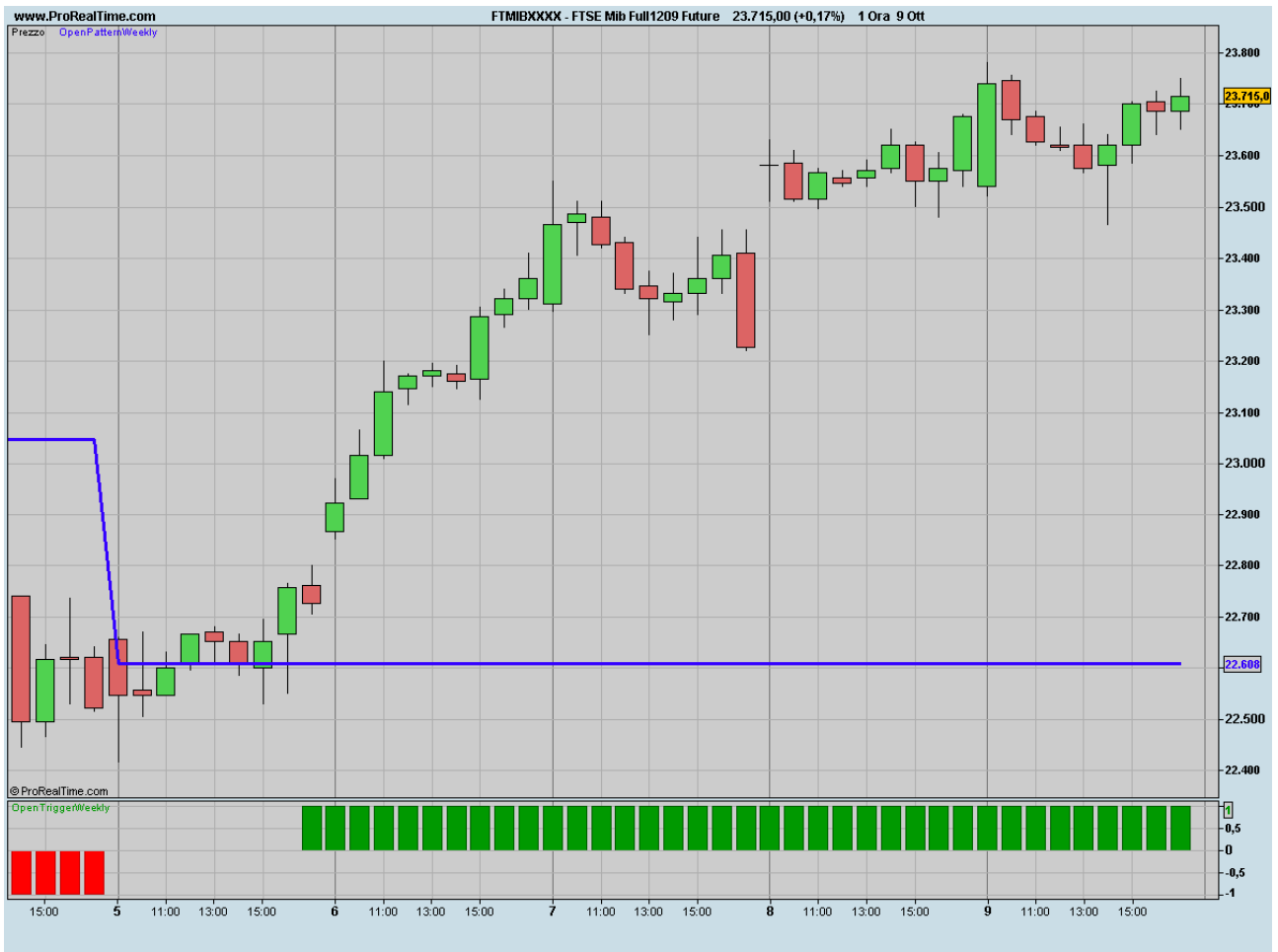
Anche in questo caso l'operatività è molto semplice.

Alle 17:30 del Lunedì verifico se il prezzo è superiore o inferiore al SI e questo mi individua la tendenza su base settimanale. Nei giorni successivi, eventuali chiusure orarie inferiori (in caso di tendenza rialzista) o superiori (in caso di tendenza ribassista) individuano il cambio di tendenza.

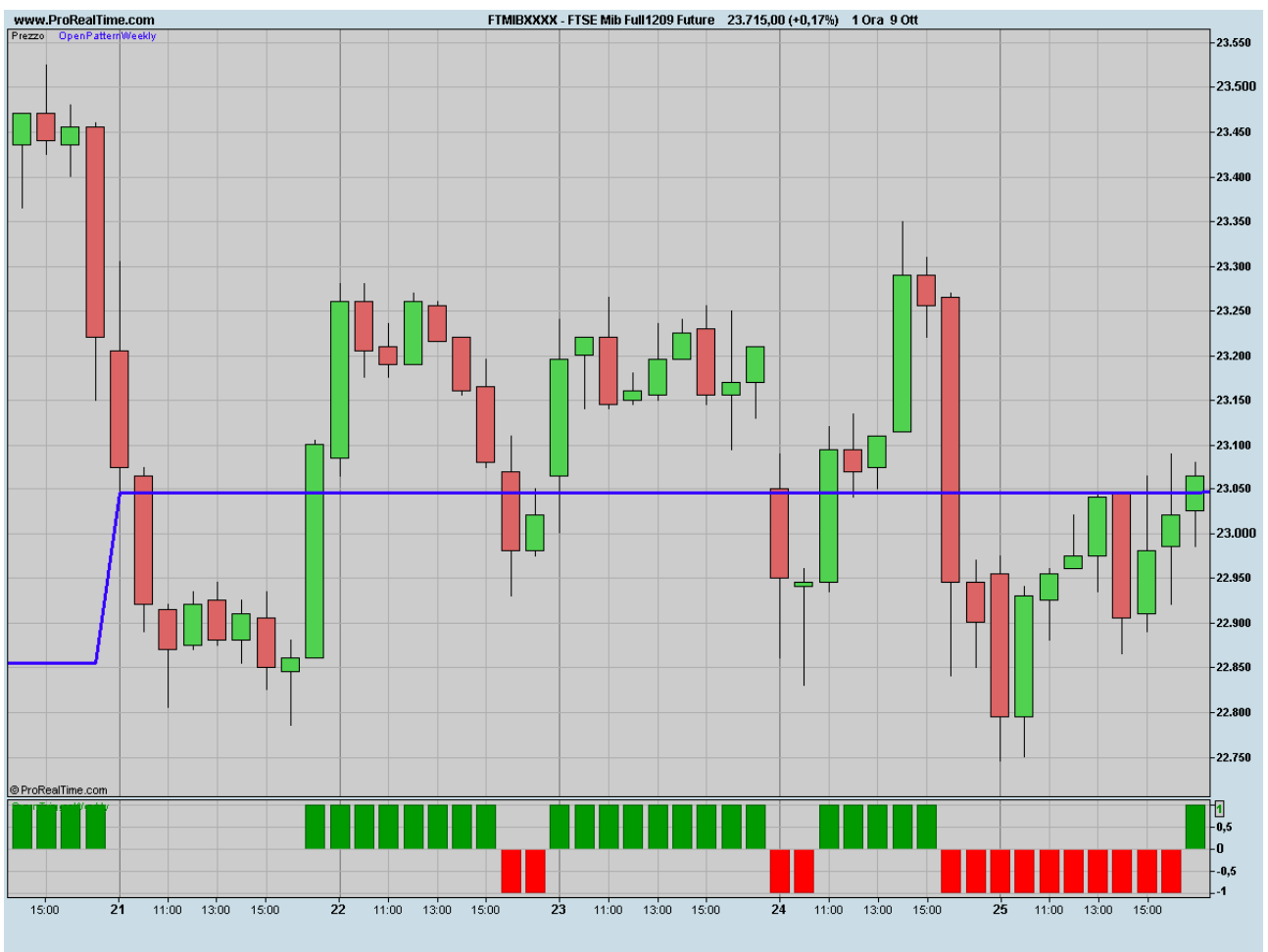
Qui di seguito riportiamo alcuni esempi pratici di applicazione del SI sul time frame settimanale.

Ricordiamo che i simboli sono identici a quelli utilizzati nel caso del time frame giornaliero.

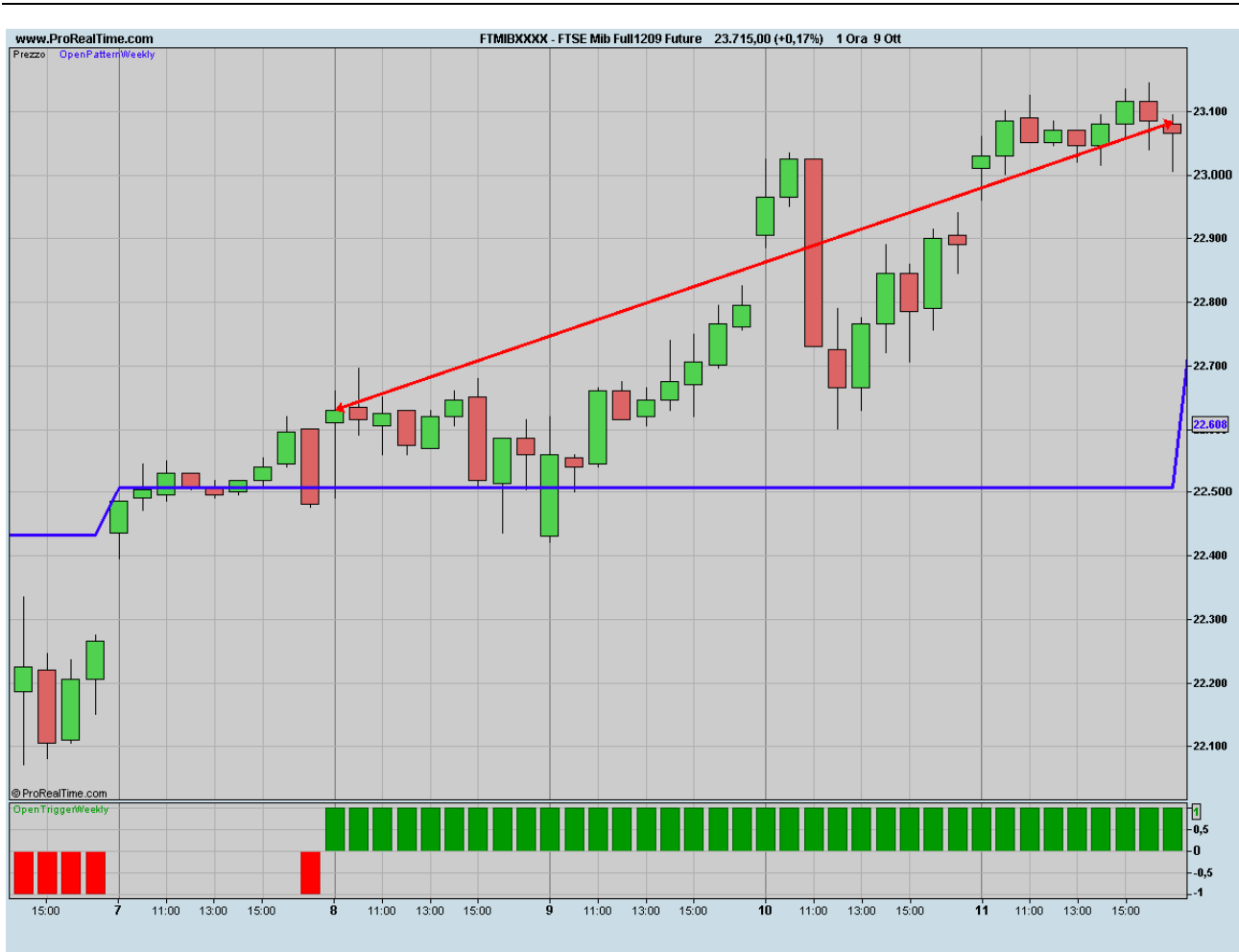
Future FTSEMIB





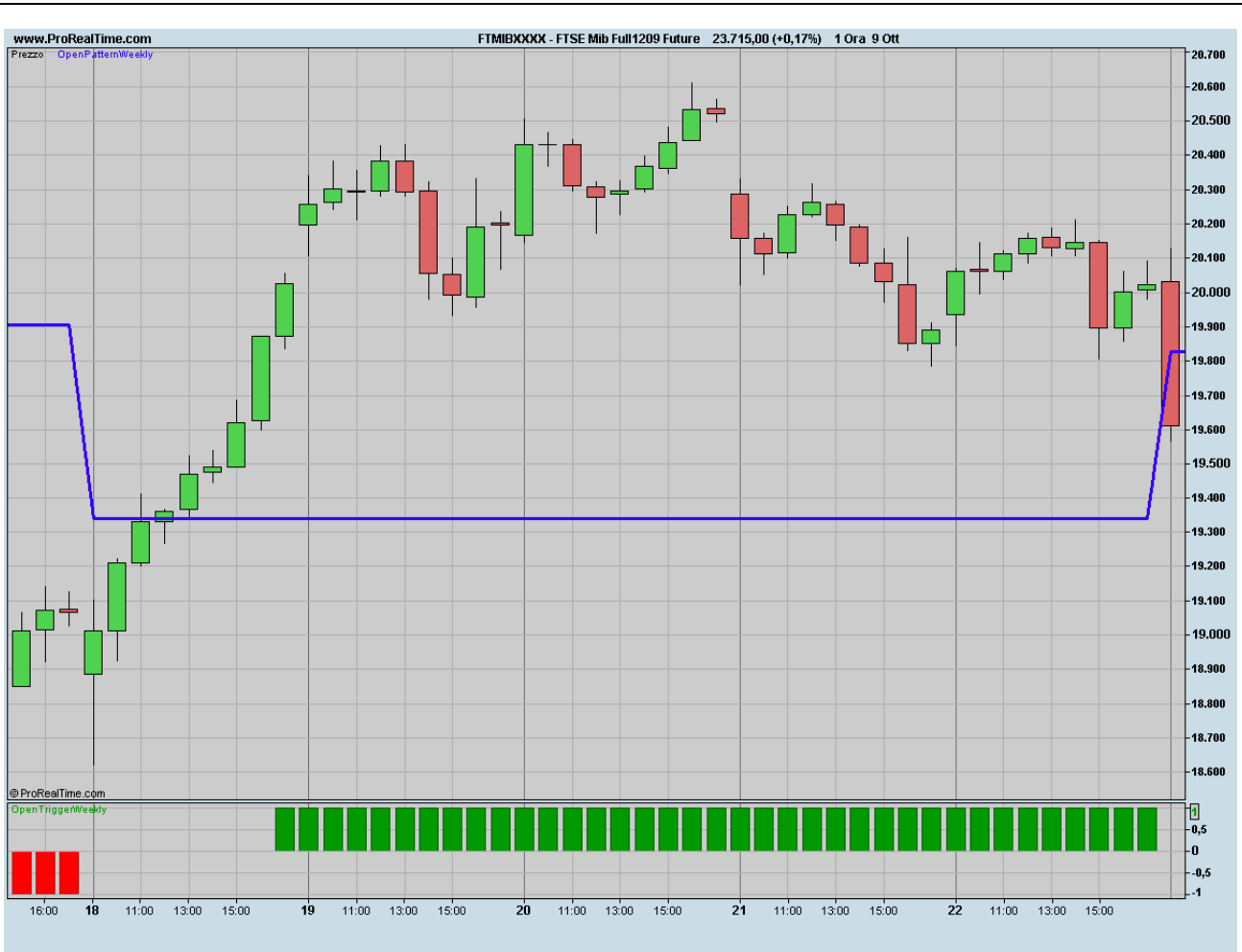












Dow Jones











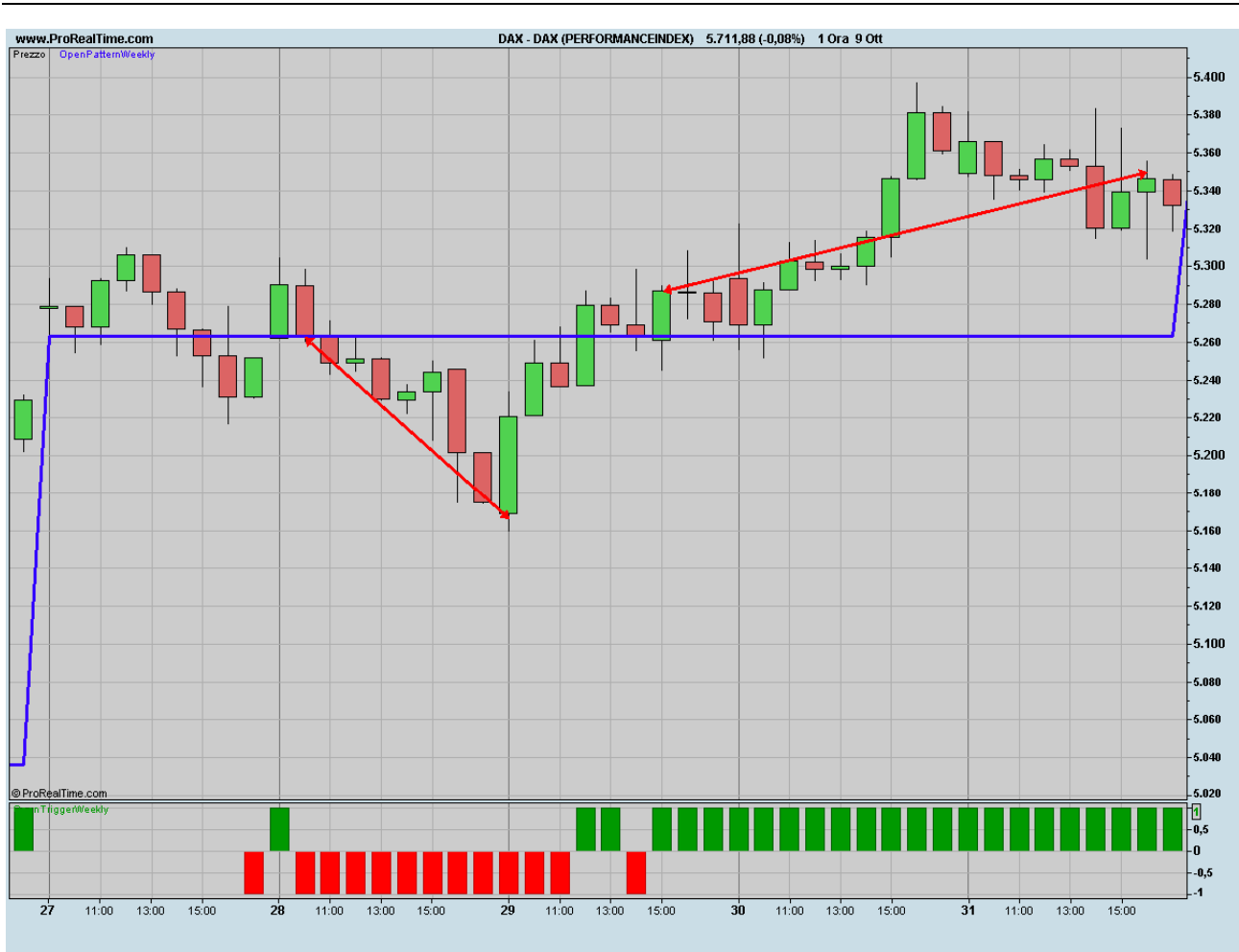


DAX Index



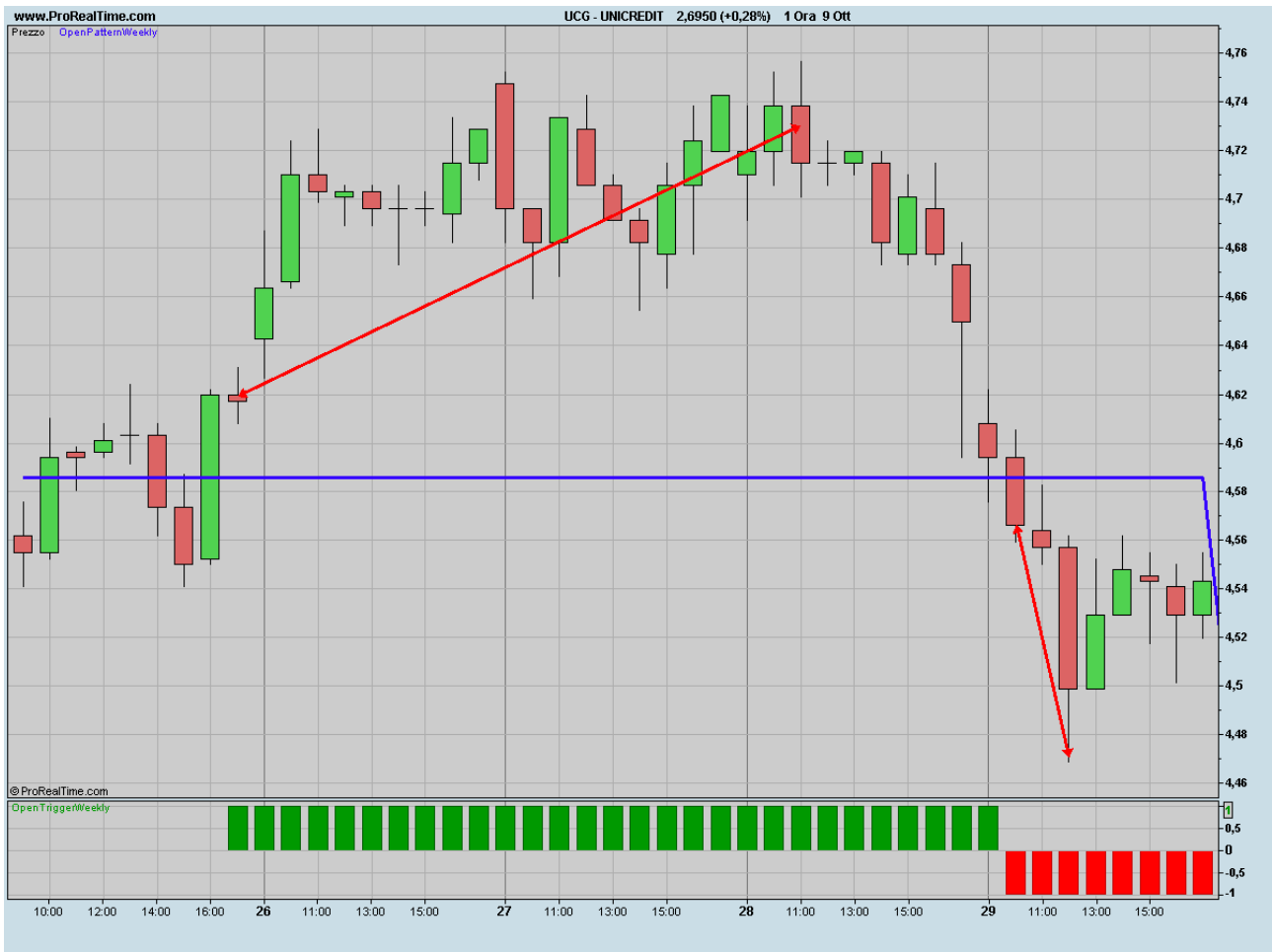


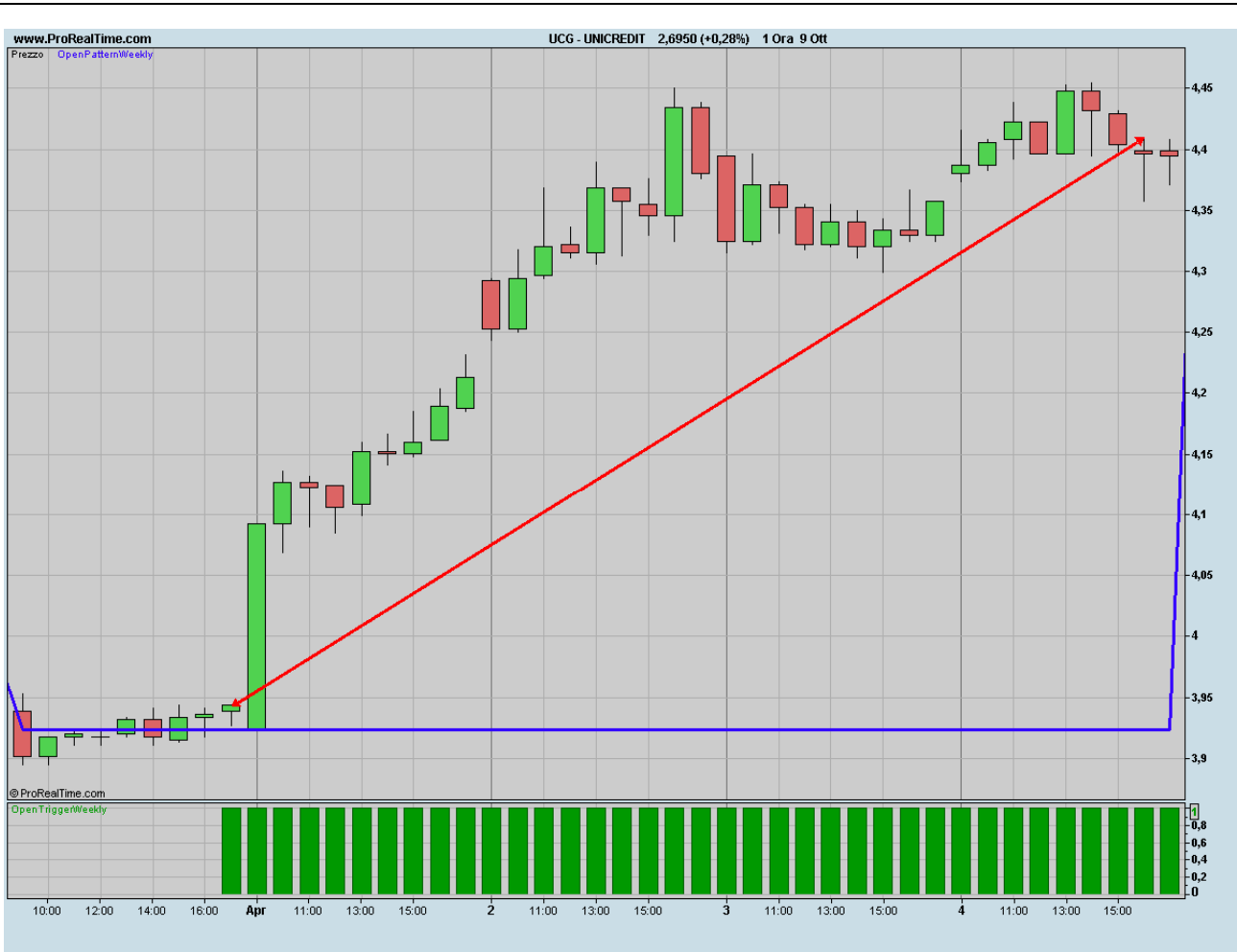






Unicredito





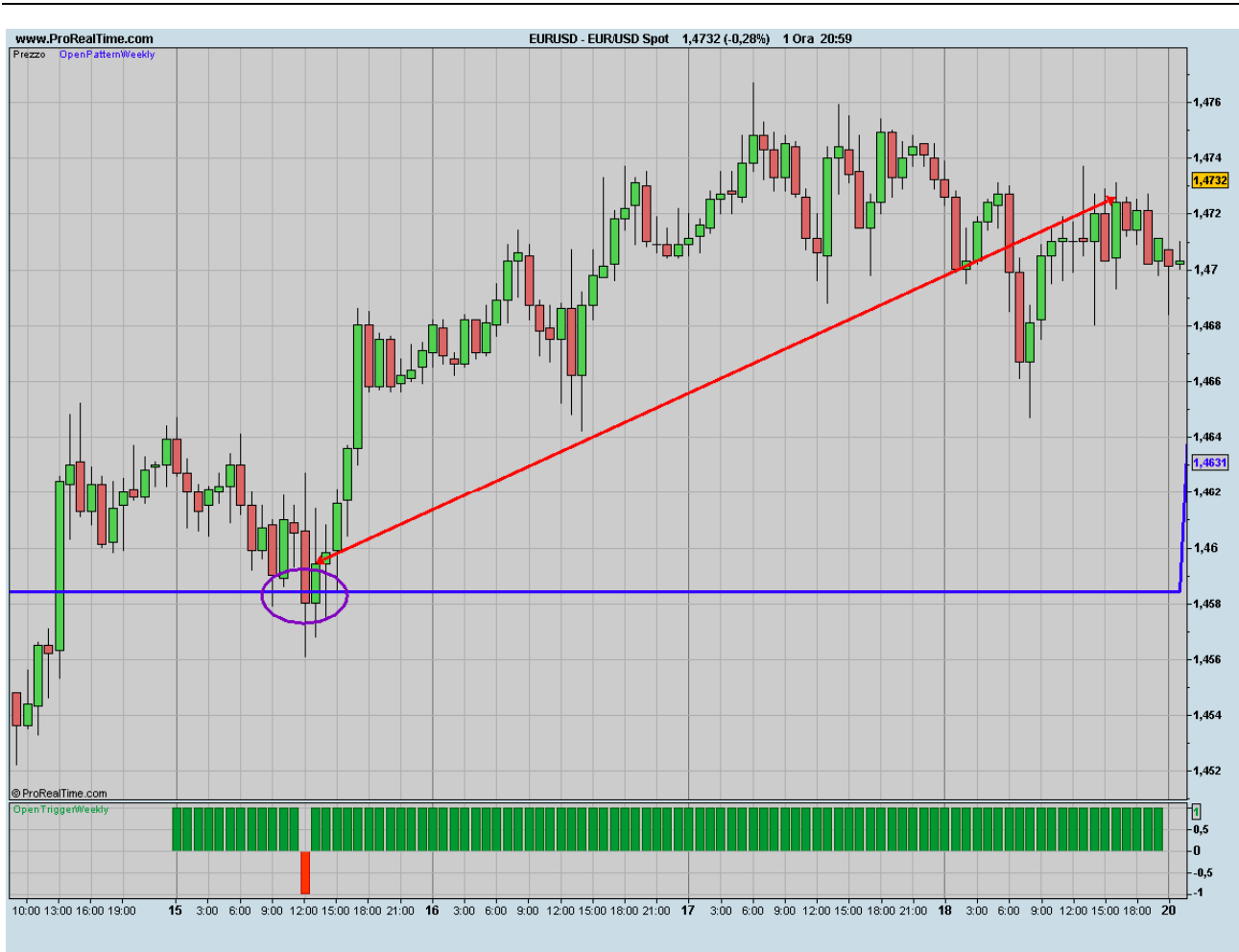




EuroDollaro









CONCLUSIONI

Molti grafici ed esempi empirici e poche "chiacchiere": Sunrise Indicator deve solo essere calcolato ed applicato. Attraverso questo indicatore, vi sarà sempre chiaro, dove un Mercato troverà supporto e resistenza, e da dove dovrebbe iniziare una fase direzionale.

Se saprete fare questo, questo Ebook, farà diventare la vostra vita da Trader una miniera d'oro.

Ad Maiora !