

Trading System



I 4 step per costruire un Trading System
sui futures con probabilità dell' 80%

Trading System

I 4 step per costruire un Trading System sui futures con
probabilità del 80%

Titolo

“Trading System”

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. **E' espressamente vietato trasmettere ad altri il presente ebook**, nè in formato cartaceo né elettronico, né per denaro né 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
INTRODUZIONE	8
DEFINIAMO LA TENDENZA	9
DEFINIAMO L' OBIETTIVO DI PREZZO	10
QUANDO E DOVE ENTRARE ED USCIRE DALLA POSIZIONE?	12
VIENE SEMPRE RAGGIUNTO L'OBIETTIVO DI PREZZO?	13
STUDIO STATISTICO DEL TRADING SYSTEM	14
SPMIB FUTURE	14
Giornaliero.....	14
Settimanale.....	15
Mensile.....	16
Sp500	18
Giornaliero.....	18
Settimanale.....	19
Mensile.....	20
DAX	22
Giornaliero.....	22
Settimanale.....	23
Mensile.....	24
Cross Euro-Dollaro	26
Giornaliero.....	26
Settimanale.....	27
Mensile.....	28
Gold Future	30
Giornaliero.....	30
Settimanale.....	31
Mensile.....	32

Bund Future	34
Giornaliero.....	34
Settimanale.....	35
Mensile.....	36
MONEY MANAGEMENT	38
COME SI UTILIZZA QUESTO TRADING SYSTEM CON EXCEL?	42
CONCLUSIONI	44

INTRODUZIONE

Il nemico numero uno del trader è l'emotività e la discrezionalità. A volte sui Mercati, le sensazioni giocano brutti scherzi, scherzi che costano caro.

Come si elimina la componente emotiva e discrezionale?

Creando un Trading System che:

- a) Definisca la Tendenza;
- b) Definisca un obiettivo di prezzo;
- c) Definisca quando e dove entrare ed uscire dalla posizione;
- d) Definisca i punti di Setup

In questo Ebook brevissimo, ci proponiamo di raggiungere tale obiettivo, elaborando un Trading System con probabilità di operazioni positive storiche dell'80%.

Questo Trading System è applicabile a Indici, Futures, Titoli, Valute e Commodities.

DEFINIAMO LA TENDENZA

L'analisi tecnica classica ci ha abituato a ragionare in questo modo per individuare la futura tendenza dei prezzi:

per aversi Tendenza rialzista dobbiamo attendere la formazione di minimi e massimi crescenti;

per aversi Tendenza ribassista dobbiamo attendere la formazione di minimi e massimi decrescenti.

Questo a volte comporta, che si entra in posizione in ritardo.

Evitando di introdurci in un argomento che non ci interessa, e non rientra nello scopo di questo ebook, affermiamo subito che c'è un metodo per definire la futura Tendenza dei prezzi che ha funzionato nella storia delle quotazioni nel 80% dei casi, e pertanto riteniamo che continuerà a funzionare.

Questo metodo è il seguente:

OMISSIS

Questo Metodo per individuare la futura Tendenza dei prezzi, può essere applicato a qualsiasi time frame, dai 5 minuti all'anno.

Esempio pratico:

OMISSIS

quindi il giorno successivo con probabilità del 80% dovrebbero essere segnati un minimo e massimo superiore (Tendenza rialzista).

Tale evento si verifica.

Noi riteniamo che questo sia il Metodo più efficace esistente al mondo per individuare la futura Tendenza di un prezzo.

DEFINIAMO L' OBIETTIVO DI PREZZO

Ricollegandoci al paragrafo precedente e ricordando quanto in esso evidenziato, possiamo subito definire delle regole operative che funzionano nel 80% dei casi:

- quando la futura Tendenza è rialzista, sul prossimo time frame, nel 80% dei casi viene segnato OMISSIS;
- quando la futura Tendenza è ribassista, sul prossimo time frame, nel 80% dei casi viene segnato OMISSIS.

Dove si formerà questo OMISSIS?

OMISSIS

Facciamo un esempio pratico

Ci troviamo in chiusura di un giorno di contrattazione che si è svolto in questi termini:

OMISSIS

Facendo gli opportuni calcoli, OMISSIS

Come possiamo e dobbiamo calcolare il prezzo del minimo del giorno successivo?

In questo modo:

OMISSIS

Quindi,

OMISSIS

Il giorno successivo il Minimo dovrebbe collocarsi al massimo in area 19.342,24

Vediamo cosa è successo realmente:

Notiamo che il Minimo si è formato OMISSIS ed è stato 19.445!!!

19490 20100 19445 20040

Tendenza ribassista (quindi, sul prossimo time frame si formerà OMISSIS).

Dove si formerà questo massimo?

Facciamo un esempio pratico

Ci troviamo in chiusura di un giorno di contrattazione che si è svolto in questi termini:

OMISSIS

Facendo gli opportuni calcoli, OMISSIS

Come possiamo e dobbiamo calcolare il prezzo del massimo del giorno successivo?

In questo modo:

OMISSIS

Quindi,

OMISSIS

Il giorno successivo il massimo dovrebbe collocarsi al massimo in area 17.695,35

Vediamo cosa è successo realmente:

17715 17715 17290 17685

Notiamo che il massimo si è formato per OMISSIS (in apertura) ed è stato 17.715!!!

Da questi esempi, vi sarete già resi conto, che in base alla futura Tendenza possiamo proiettare o il prezzo massimo del minimo o il prezzo massimo del massimo, cioè la massima estensione del minimo o del massimo.

La precisione sarà chirurgica?

Non sempre, ma ne ripareremo nei prossimi paragrafi.

QUANDO E DOVE ENTRARE ED USCIRE DALLA POSIZIONE?

Fino ad adesso abbiamo definito la futura Tendenza dei prezzi ed abbiamo definito l'obiettivo del minimo futuro o del massimo, a secondo della Tendenza stessa.

Ora andiamo a definire quando entrare ed uscire dalla posizione, riportando qualche esempio che è applicabile poi, su diversi time frame.

Precisiamo subito che questo Trading System ci permette solo due tipi di operatività:

Operatività OMISSIS ed Operatività OMISSIS.

Esempio operativo Operatività:

OMISSIS

Esempio operativo Operatività:

OMISSIS

Conclusioni

Avete notato?

Abbiamo creato il nostro Trading System che:

- a) Definisce la Tendenza;
- b) Definisce un obiettivo di prezzo;
- c) Definisce quando e dove entrare ed uscire dalla posizione.

VIENE SEMPRE RAGGIUNTO L'OBIETTIVO DI PREZZO?

Nei paragrafi precedenti abbiamo definito la regola che in base alla Tendenza futura dei prezzi, ci permette di individuare o il prezzo del massimo o il prezzo del minimo.

Saranno sempre centrati questi obiettivi?

No, ma i prezzi vi si avvicineranno molto spesso (nel 80% dei casi ca), e alcune volte saranno superati al rialzo o al ribasso.

L'aspetto più interessante di questo Trading System è la libertà, in quanto bisogna dedicare all'investimento nemmeno 5 minuti al giorno:

sia per l'Operatività OMISSIS, basta fissare Prezzo di Ingresso, Stop e Take Profit e staccarsi dai monitors.

Questo Trading System quindi, si adatta alle esigenze dell'impiegato, del libero professionista, della casalinga, del pensionato, del viaggiatore: a volte si rimarrà Flat perché non verrà raggiunto il Prezzo di ingresso (questo è valido solo per l' Operatività OMISSIS), altre volte si chiuderà in pari, altre volte in perdita.

Ora definiamo le regole per i casi di mancato raggiungimento dell'obiettivo di Prezzo:

Mancato raggiungimento del Prezzo di entrata nella posizione:

Per quel time frame (ora, giorno, settimana, o mese) si rimane Flat, anche se in realtà si potrebbe decidere di operare con le stesse regole su un time frame diverso.

Mancato raggiungimento del Take Profit:

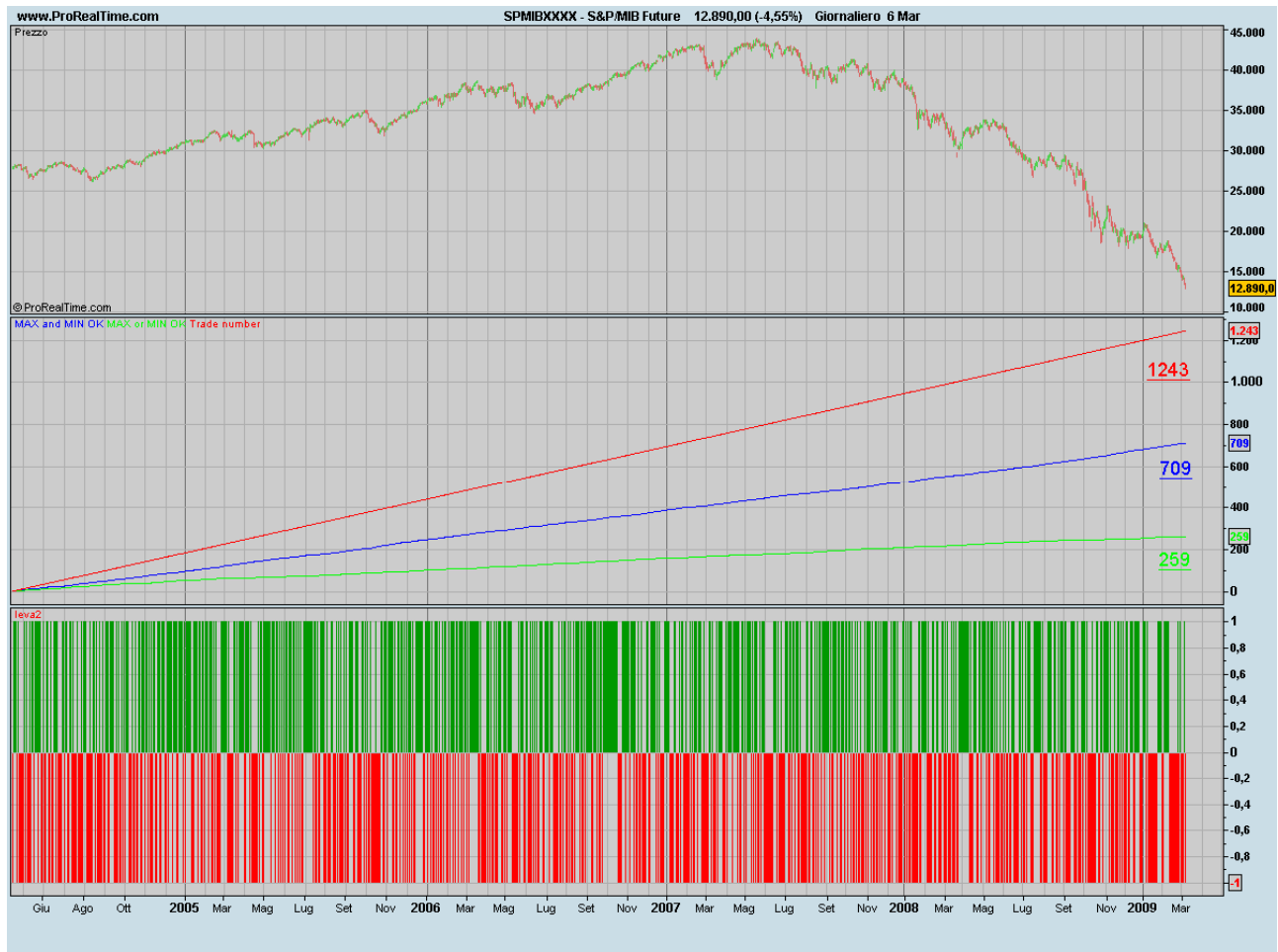
Alla chiusura del time frame su cui si opera si chiude la posizione.

STUDIO STATISTICO DEL TRADING SYSTEM

In questo capitolo riportiamo lo studio statistico del Trading System descritto in precedenza su 3 diversi time frames: giornaliero, settimanale e mensile.

SPMIB FUTURE

GIORNALIERO



Nella figura precedente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni giornaliere del SPMIB Future dal 2004 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

- la linea rossa indica il numero di giorni di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 1243);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 709);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 259);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura giornaliera è superiore (istogramma verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva giornaliera.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per il giorno successivo, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 57% (709/1243);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 21%;
- in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 78%.

SETTIMANALE

Nella figura seguente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni settimanali del SPMIB Future dal 2004 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

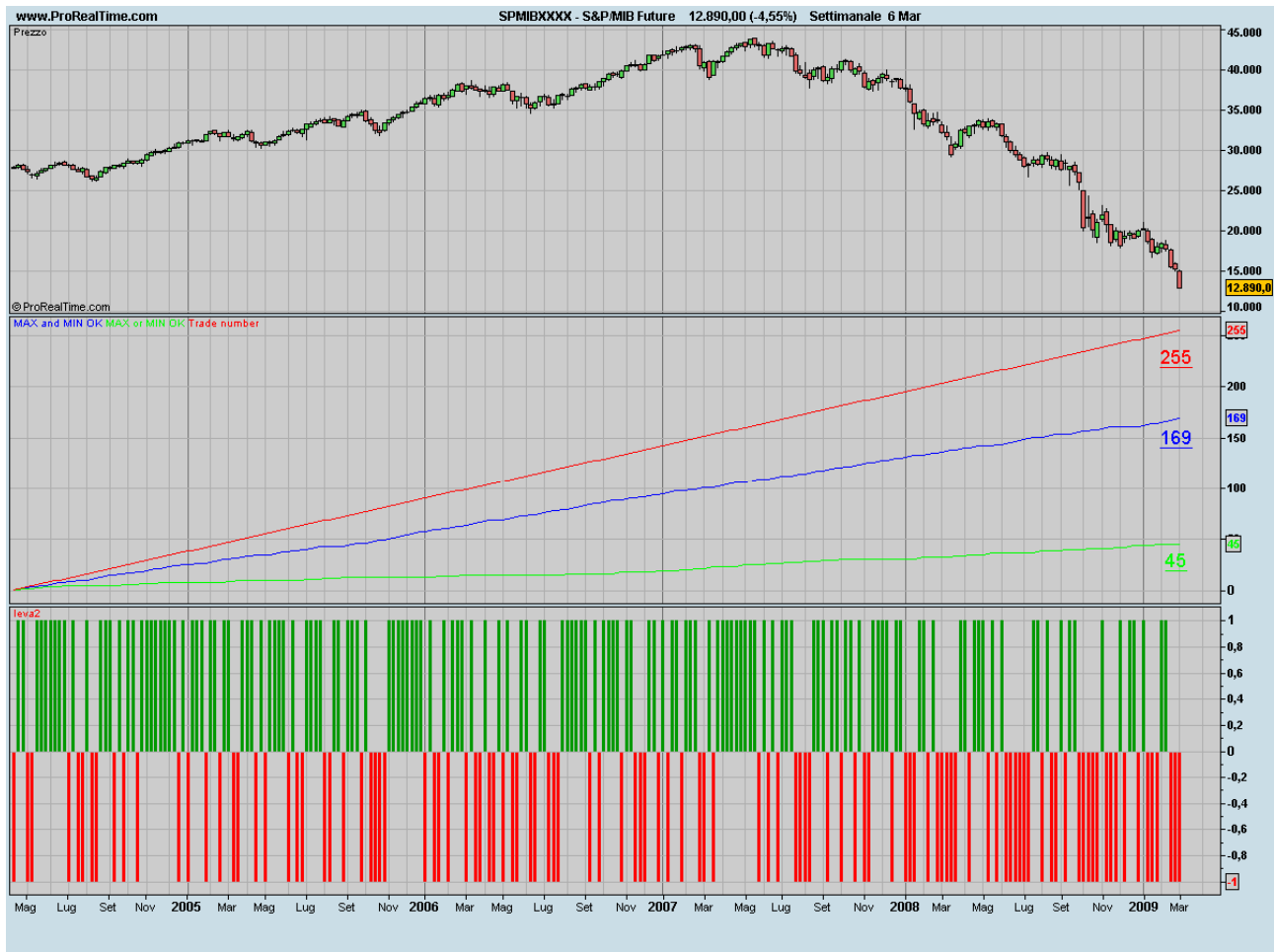
- la linea rossa indica il numero di settimane di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 255);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 169);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 45);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura settimanale è superiore (istogramma verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva settimanale.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per la settimana successiva, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 66% (169/255);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 18%;
- in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del

84%.



MENSILE

Nella figura seguente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni mensili del SPMIB Future dal 2004 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

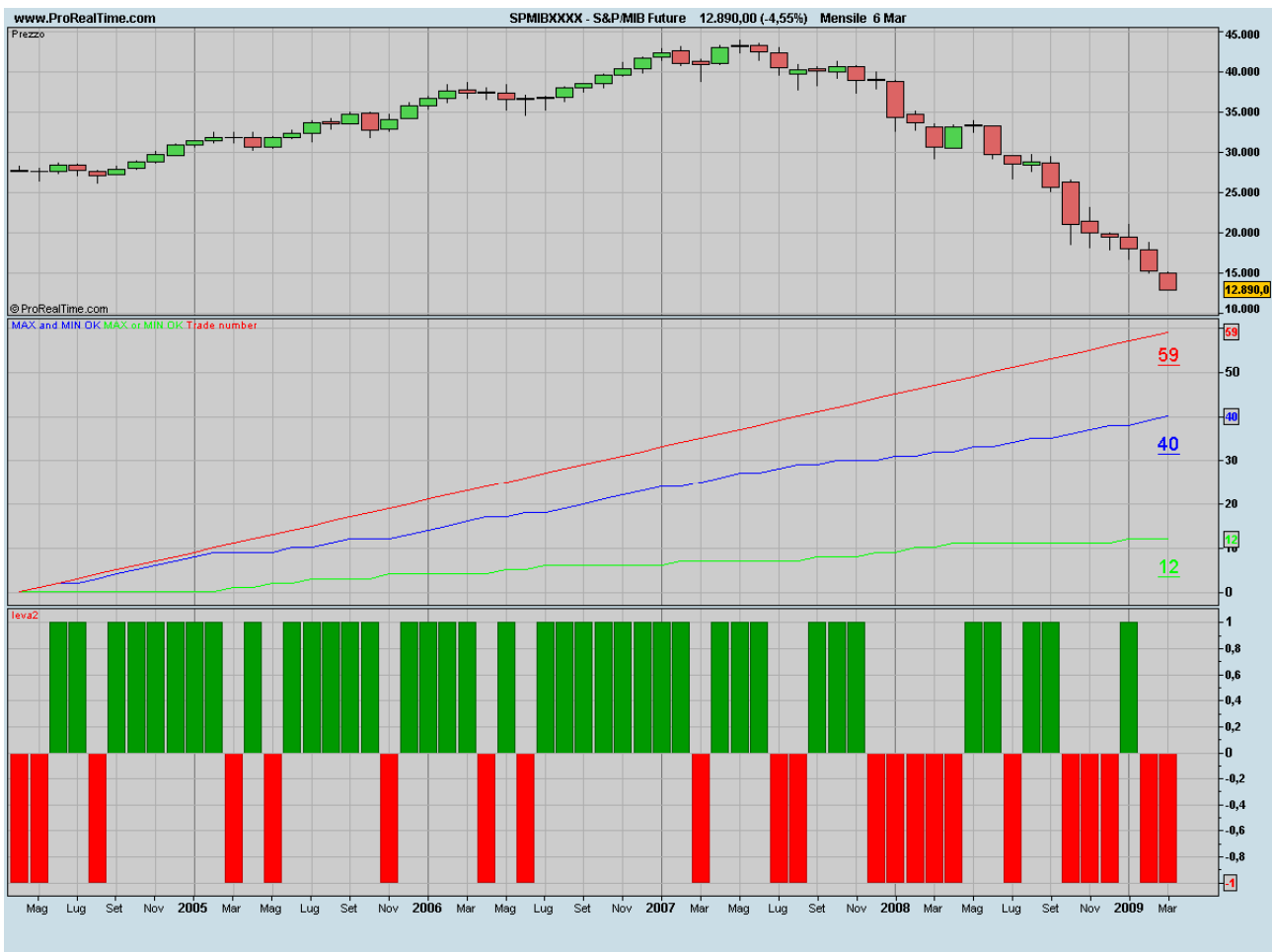
- la linea rossa indica il numero di mesi di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 59);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 40);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 12);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura mensile è superiore (istogramma verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva mensile.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

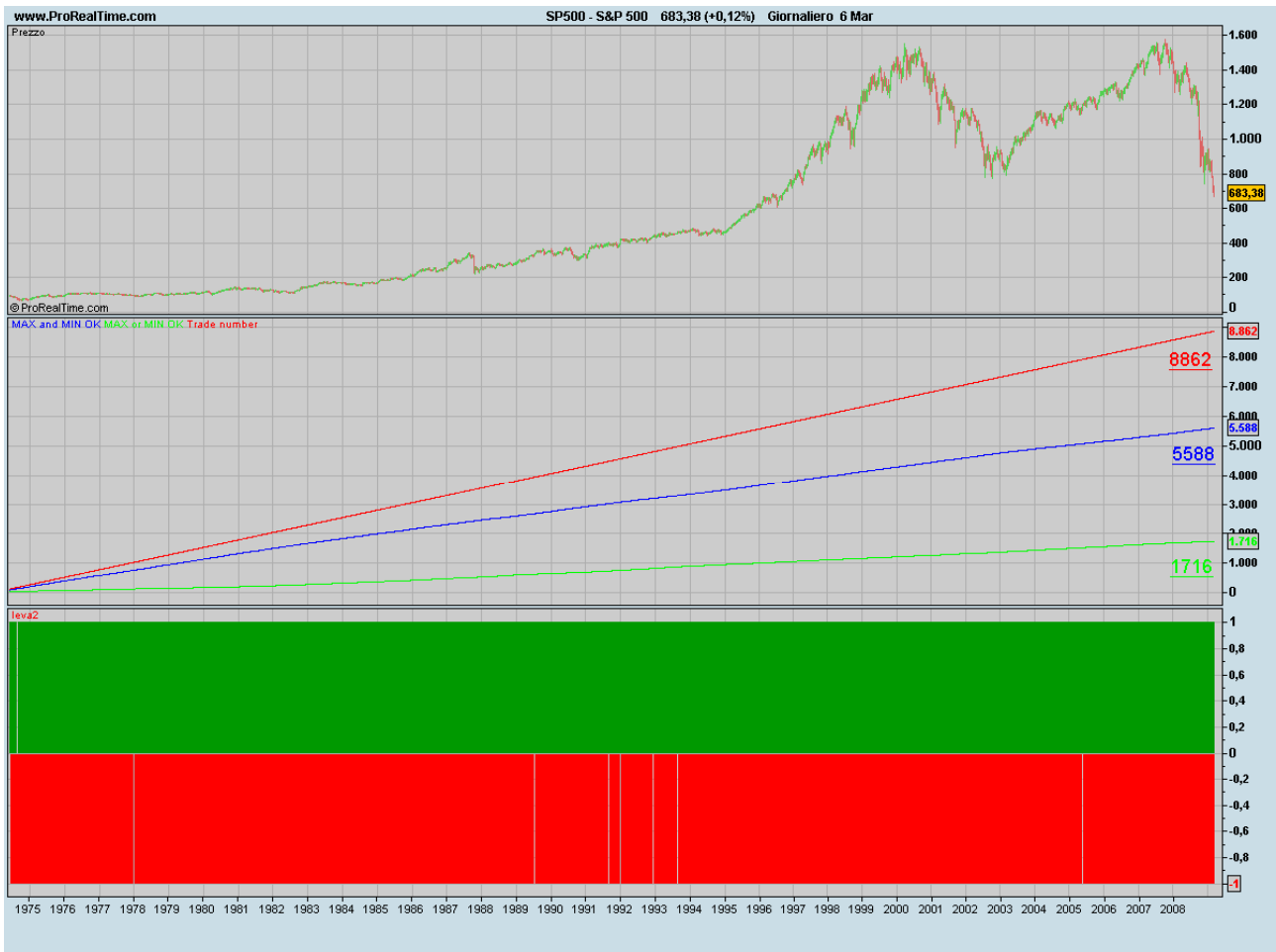
- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per il mese successivo, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 68% (40/59);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 20%;

in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 88%.



SP500

GIORNALIERO



Nella figura precedente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni giornaliere del SP500 dal 1974 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

- la linea rossa indica il numero di giorni di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 8862);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 5588);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 1716);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura giornaliera è superiore (istogramma verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva giornaliera.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per il giorno successivo, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 63% (5588/8862);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 19%;

in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 82%.

SETTIMANALE

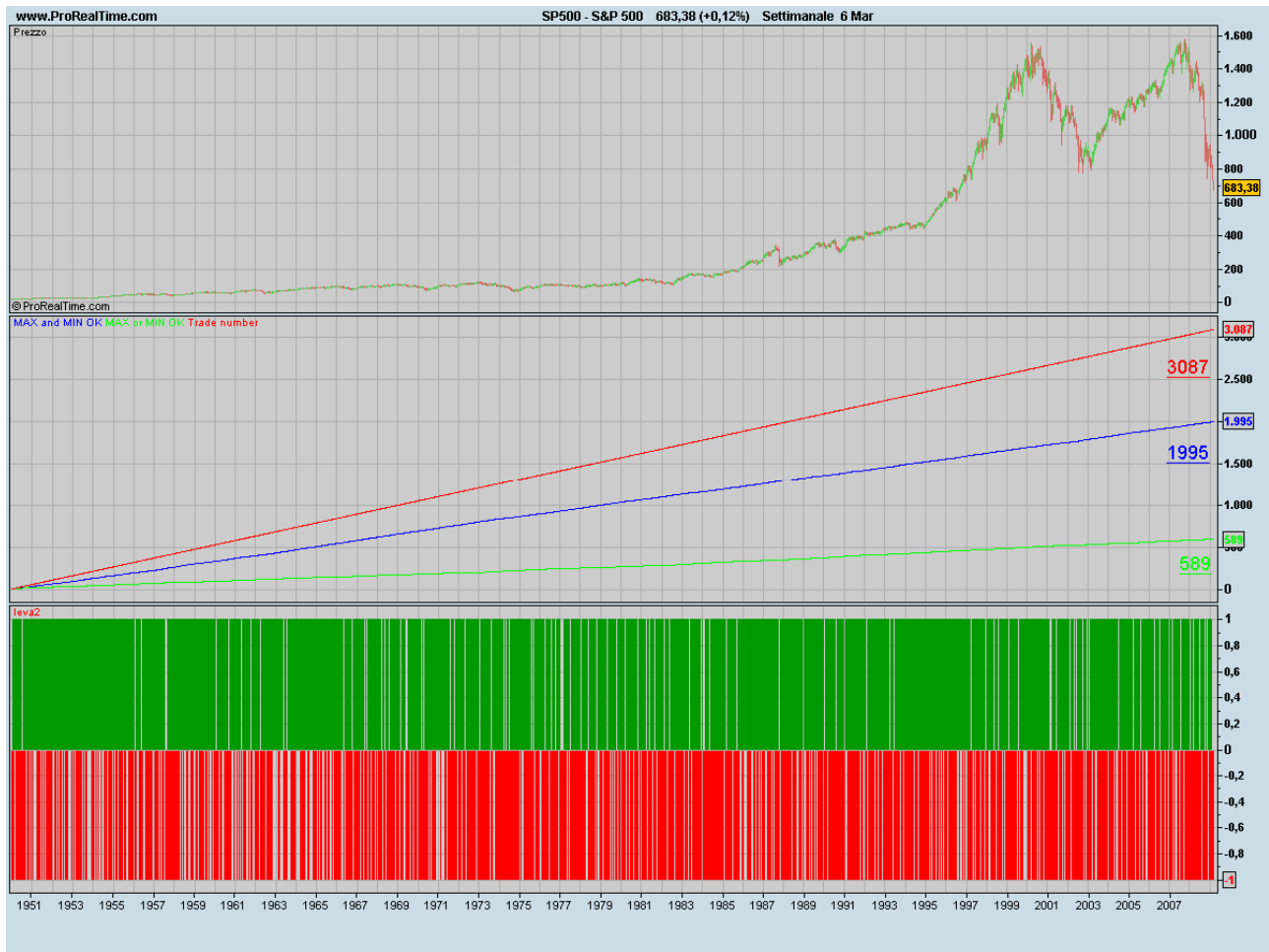
Nella figura seguente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni settimanali del SP500 dal 1950 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

- la linea rossa indica il numero di settimane di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 3087);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 1995);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 589);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura settimanale è superiore (istogramma verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva settimanale.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per la settimana successiva, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 65% (1995/3087);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 19%;
- in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 84%.



MENSILE

Nella figura seguente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni mensili del SP500 dal 1950 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

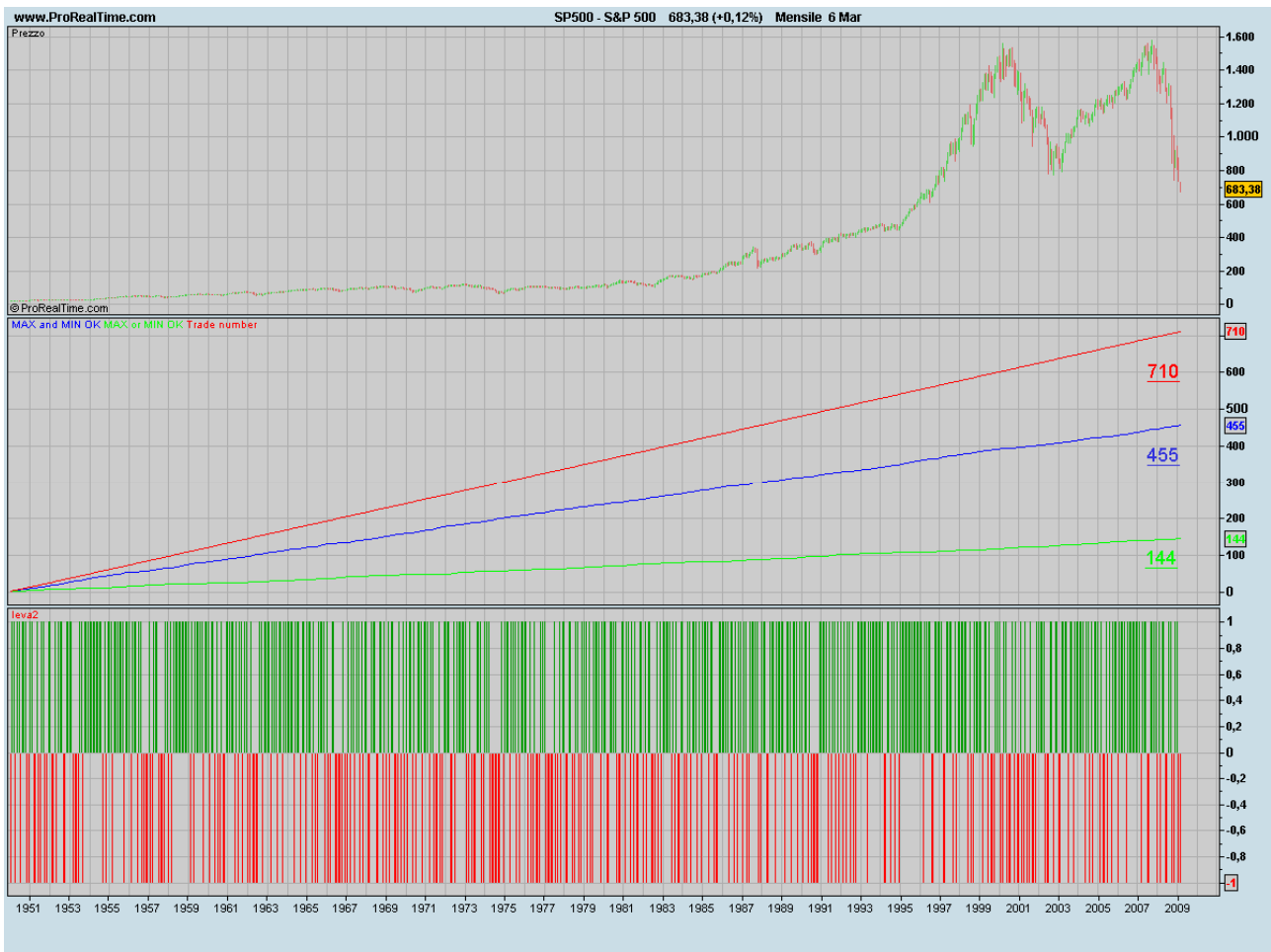
- la linea rossa indica il numero di mesi di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 710);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 455);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 144);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura mensile è superiore (istogramma verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva mensile.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

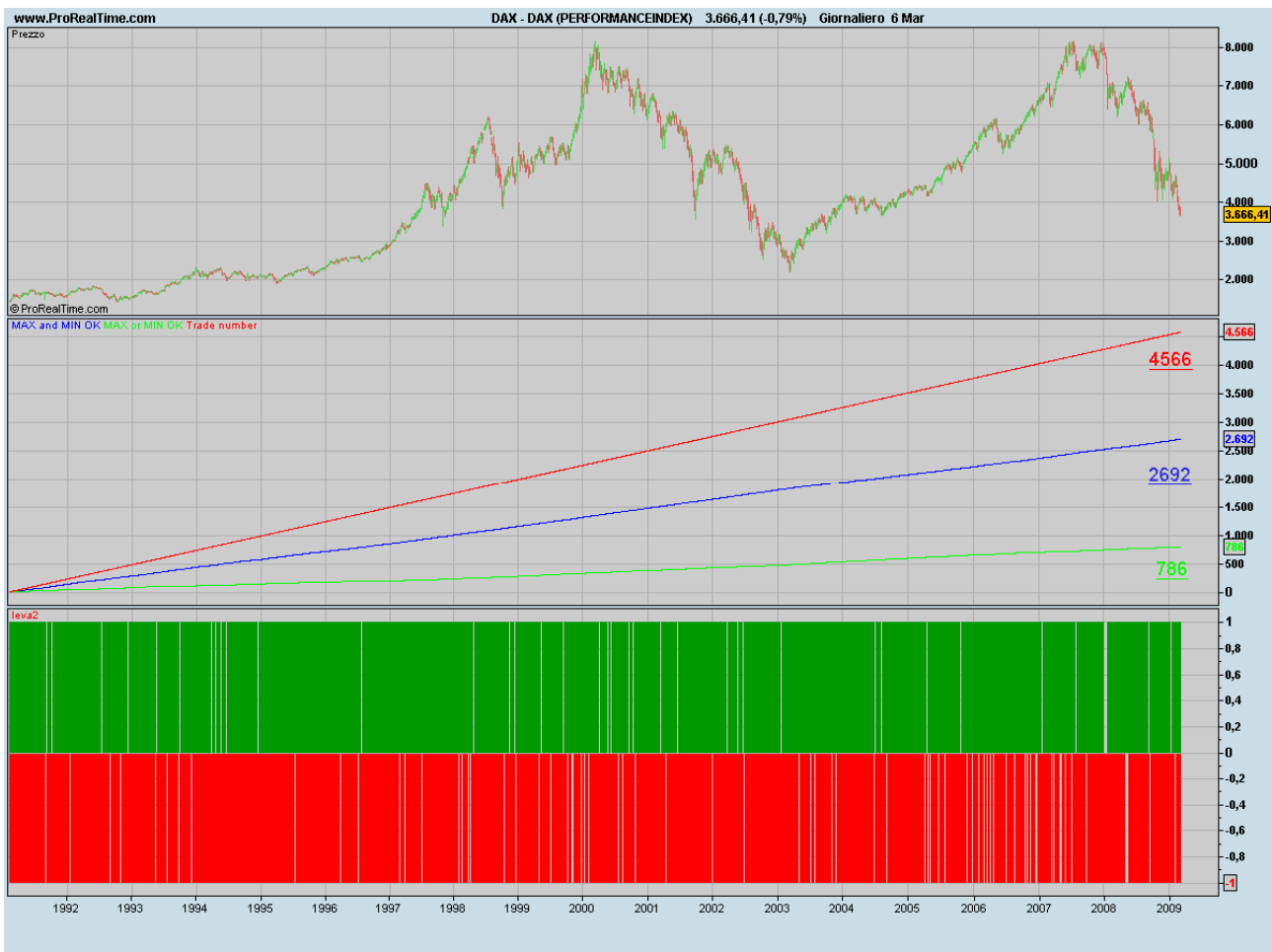
- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per il mese successivo, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 64% (455/710);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 20%;

in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 84%.



DAX

GIORNALIERO



Nella figura precedente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni giornaliere del DAX dal 1991 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

- la linea rossa indica il numero di giorni di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 4566);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 2692);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 786);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura giornaliera è superiore (istogramma

verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva giornaliera.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per il giorno successivo, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 59% (2692/4566);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 17%;

in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 76%.

SETTIMANALE

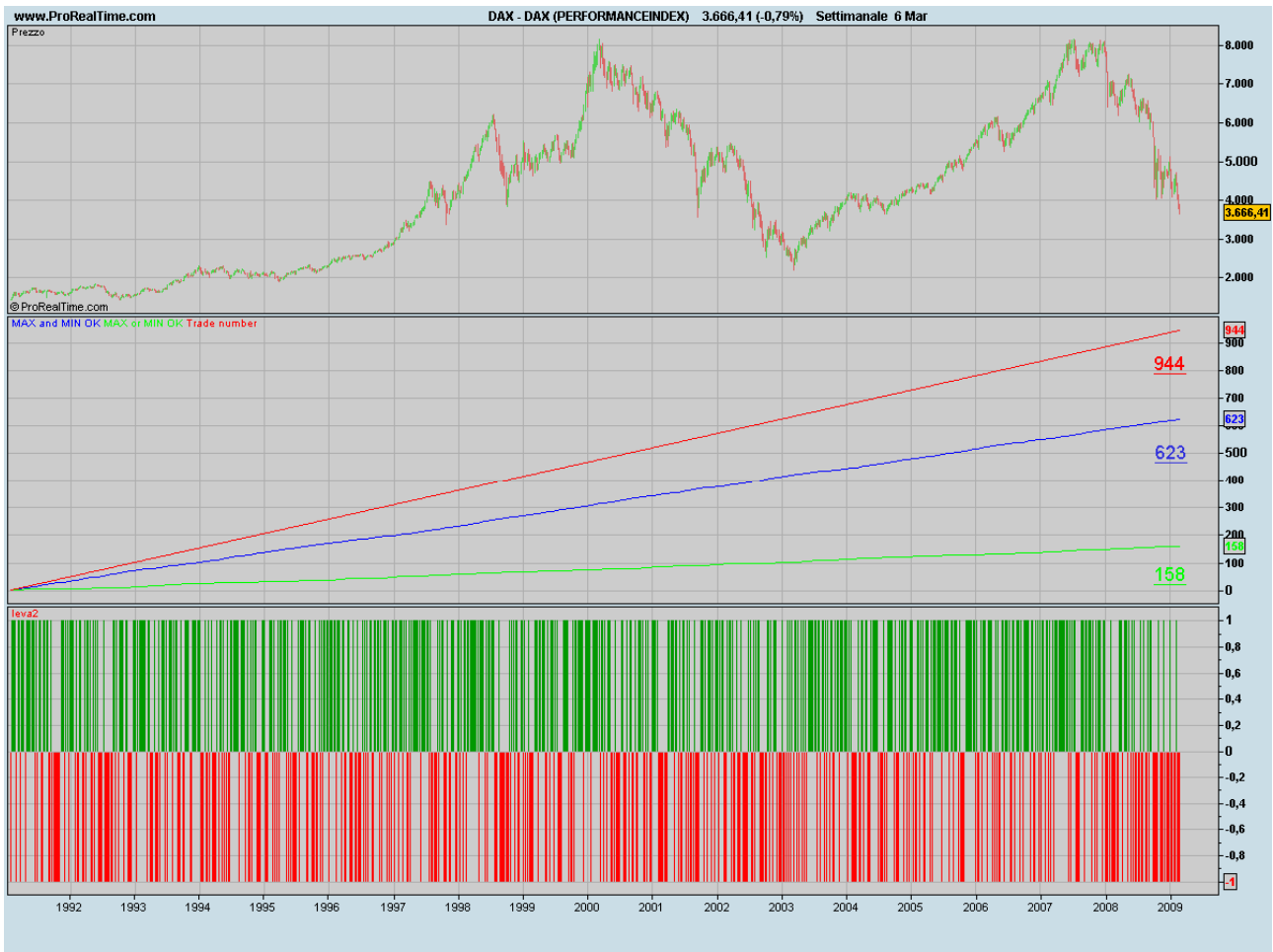
Nella figura seguente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni settimanali del DAX dal 1991 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

- la linea rossa indica il numero di settimane di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 944);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 623);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 158);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura settimanale è superiore (istogramma verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva settimanale.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per la settimana successiva, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 66% (623/944);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 17%;
- in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 83%.



MENSILE

Nella figura seguente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni mensili del DAX dal 1991 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

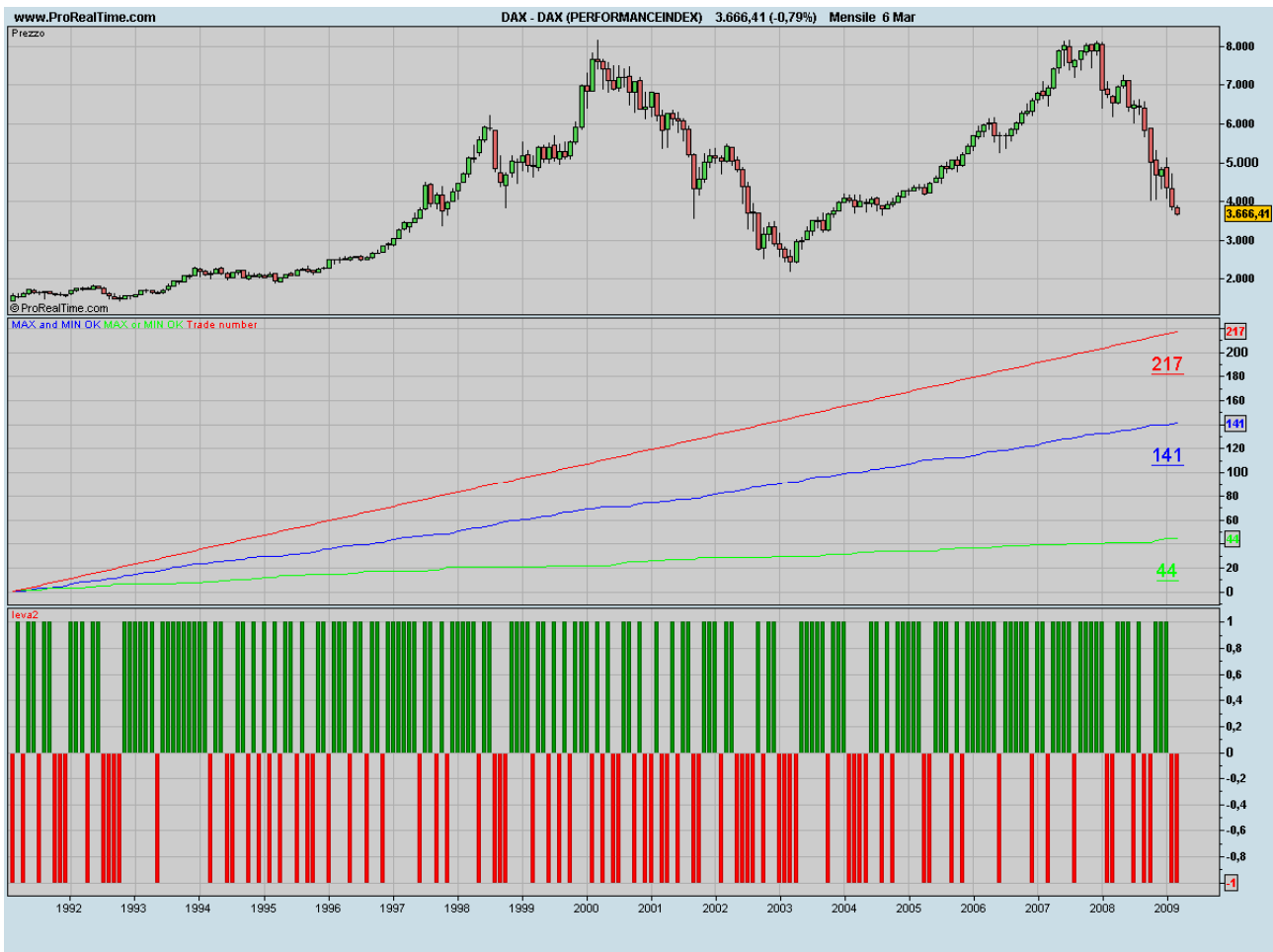
- la linea rossa indica il numero di mesi di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 217);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 141);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 44);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura mensile è superiore (istogramma verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva mensile.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

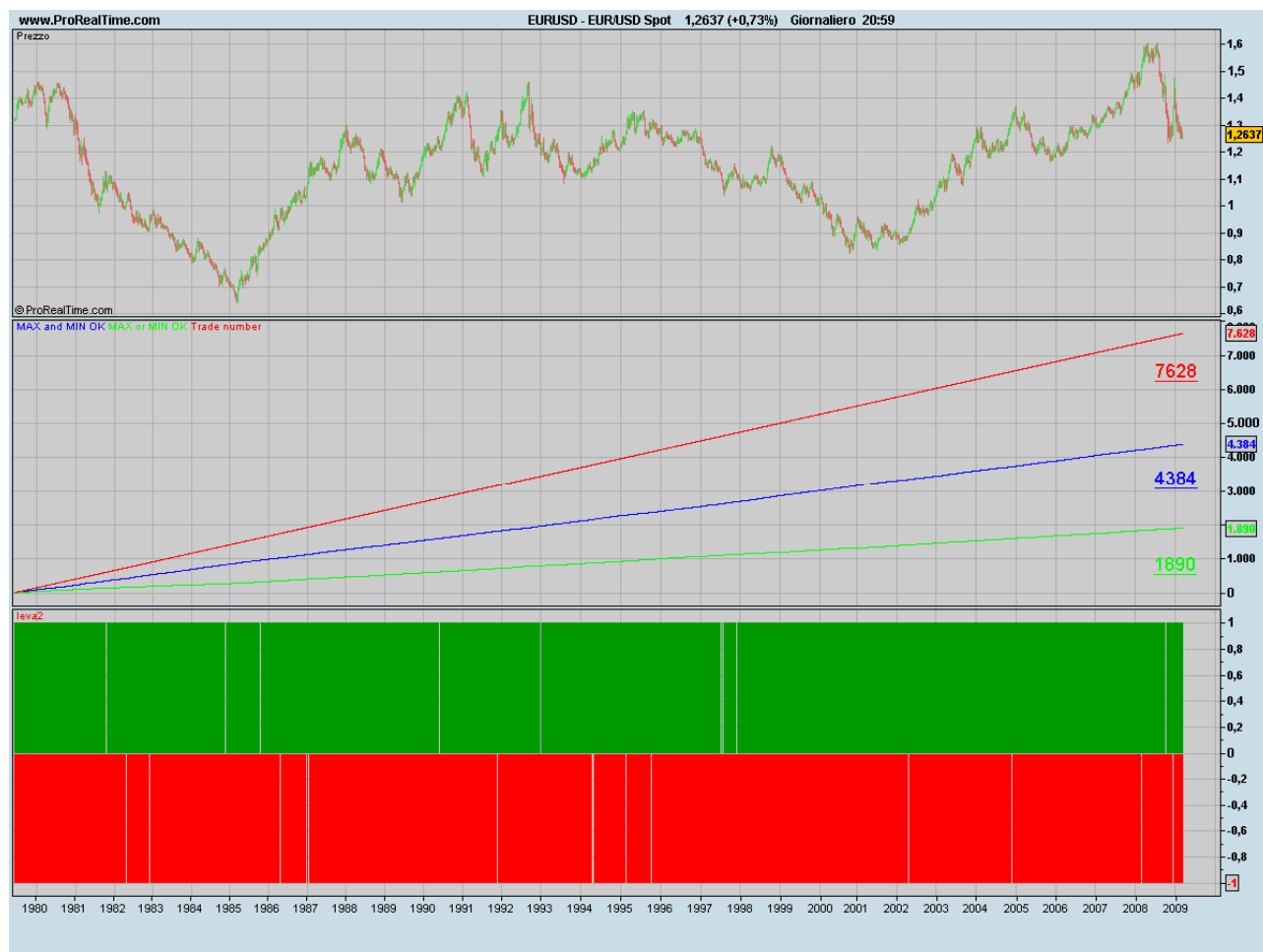
- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per il mese successivo, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 65% (141/217);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 20%;

in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 85%.



CROSS EURO-DOLLARO

GIORNALIERO



Nella figura precedente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni giornaliere del cross Euro-Dollaro dal 1980 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

- la linea rossa indica il numero di giorni di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 7628);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 4384);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 1890);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura giornaliera è superiore (istogramma

verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva giornaliera.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per il giorno successivo, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 57% (4384/7628);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 25%;

in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 82%.

SETTIMANALE

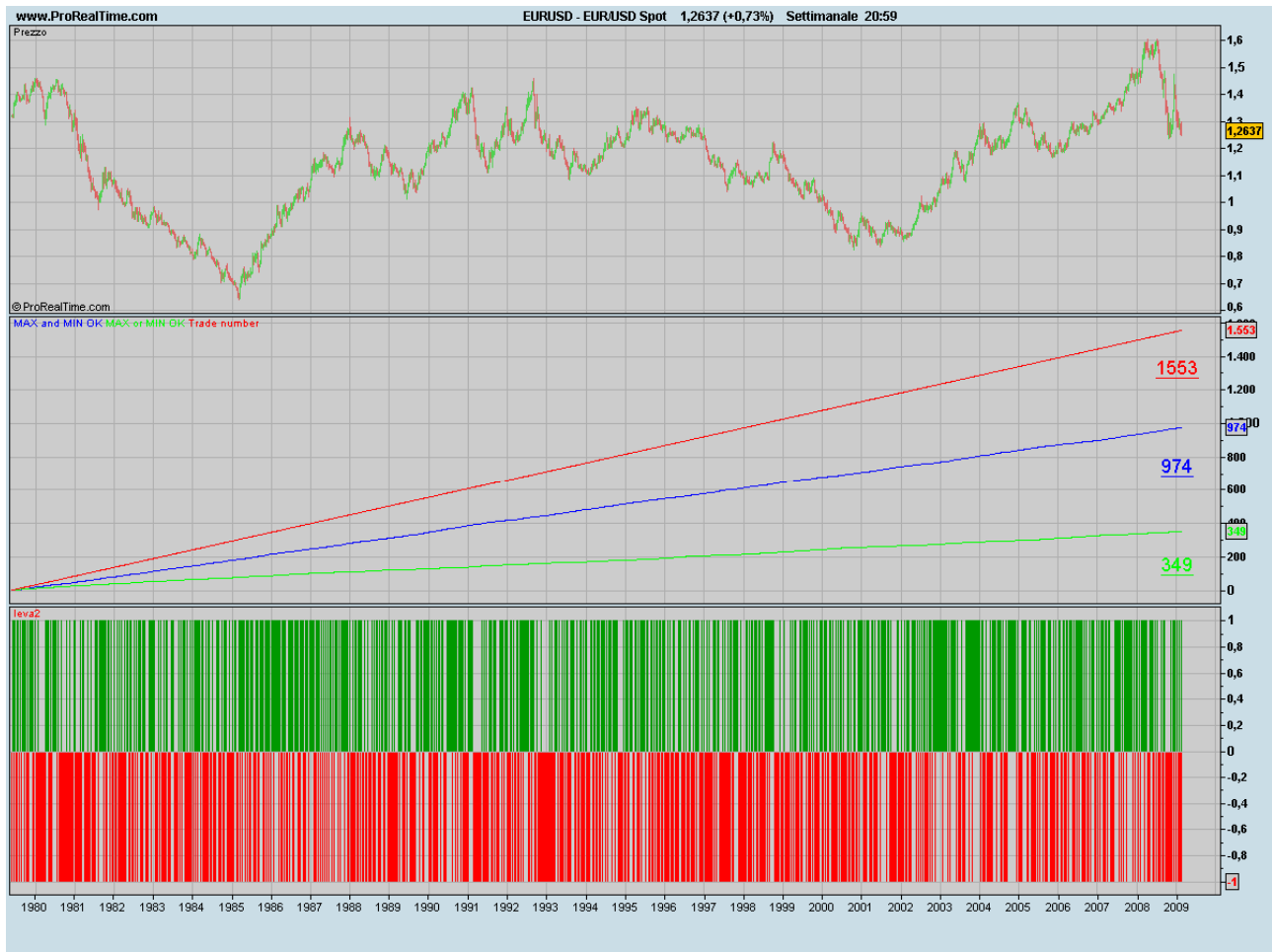
Nella figura seguente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni settimanali del cross Euro-Dollaro dal 1980 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

- la linea rossa indica il numero di settimane di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 1553);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 974);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 349);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura settimanale è superiore (istogramma verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva settimanale.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per la settimana successiva, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 63% (974/1553);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 22%;
- in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 85%.



MENSILE

Nella figura seguente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni mensili del cross Euro-Dollaro dal 1980 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

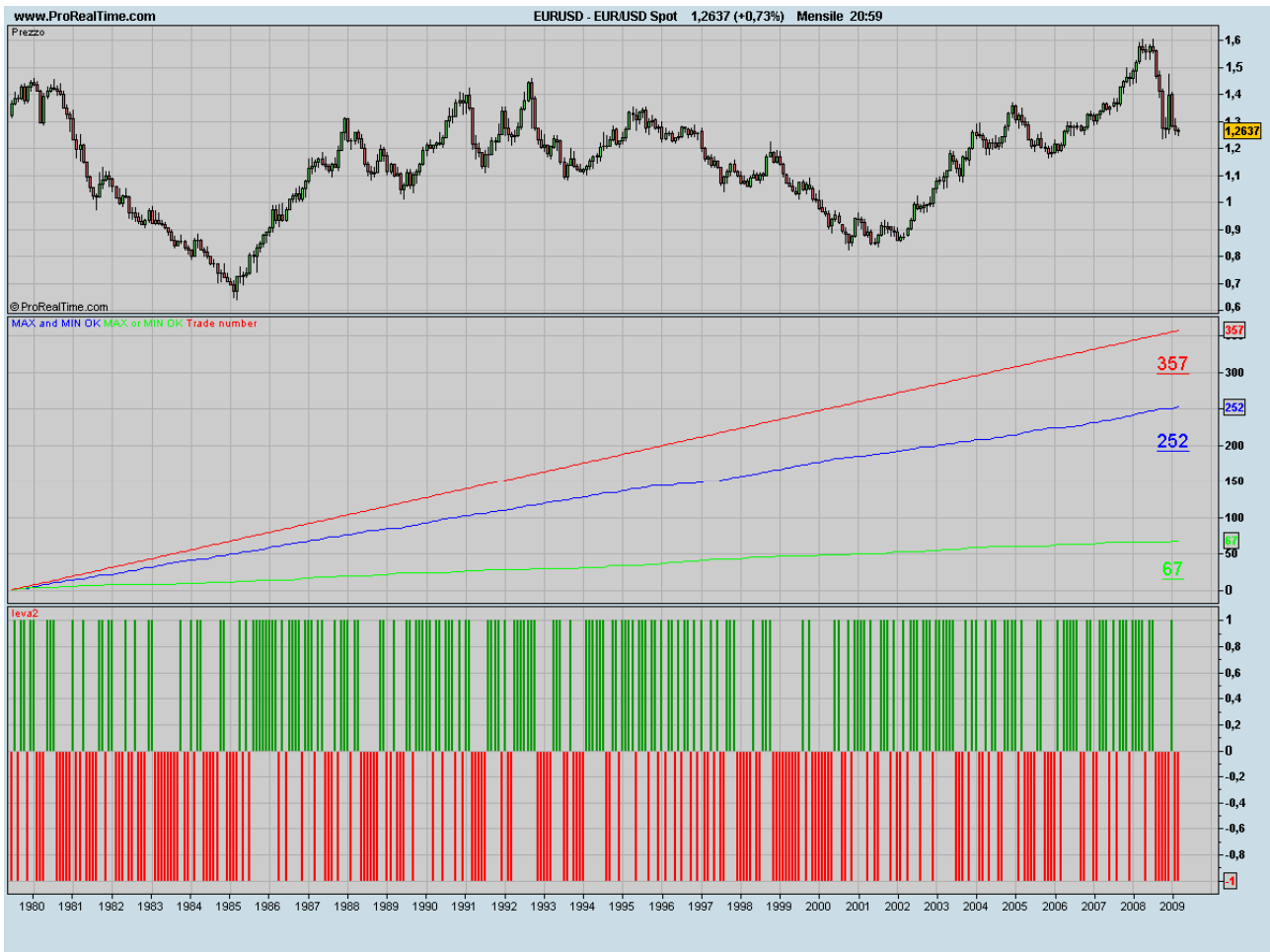
- la linea rossa indica il numero di mesi di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 357);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 252);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 67);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura mensile è superiore (istogramma verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva mensile.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

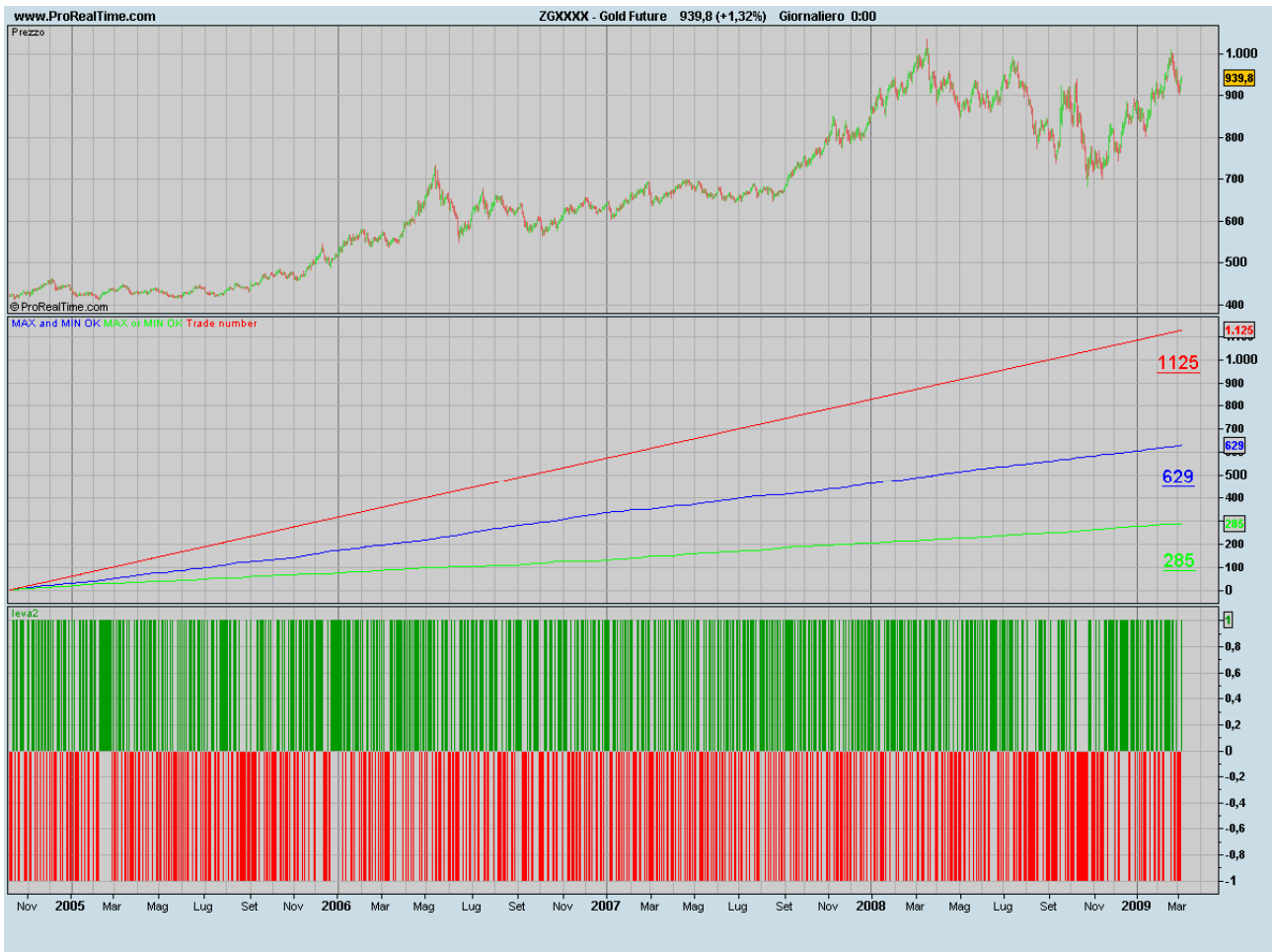
- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per il mese successivo, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 71% (252/357);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 19%;

in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 90%.



GOLD FUTURE

GIORNALIERO



Nella figura precedente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni giornaliere del Gold Future dal 2005 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

- la linea rossa indica il numero di giorni di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 1125);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 629);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 285);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura giornaliera è superiore (istogramma

verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva giornaliera.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per il giorno successivo, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 56% (629/1125);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 25%;

in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 81%.

SETTIMANALE

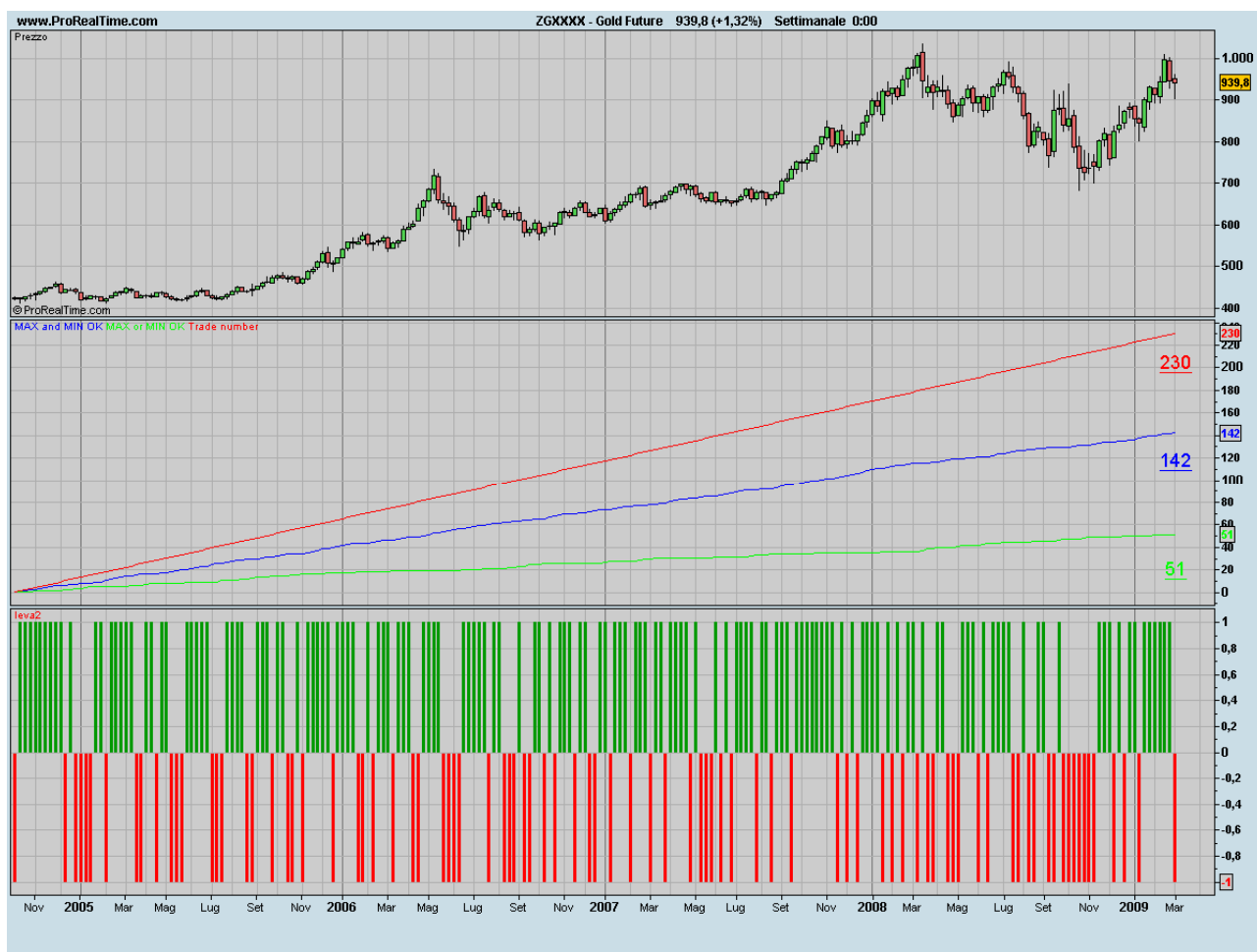
Nella figura seguente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni settimanali del Gold Future dal 2005 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

- la linea rossa indica il numero di settimane di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 230);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 142);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 51);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura settimanale è superiore (istogramma verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva settimanale.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per la settimana successiva, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 62% (142/230);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 22%;
- in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 84%.



MENSILE

Nella figura seguente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni mensili del Gold Future dal 2005 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

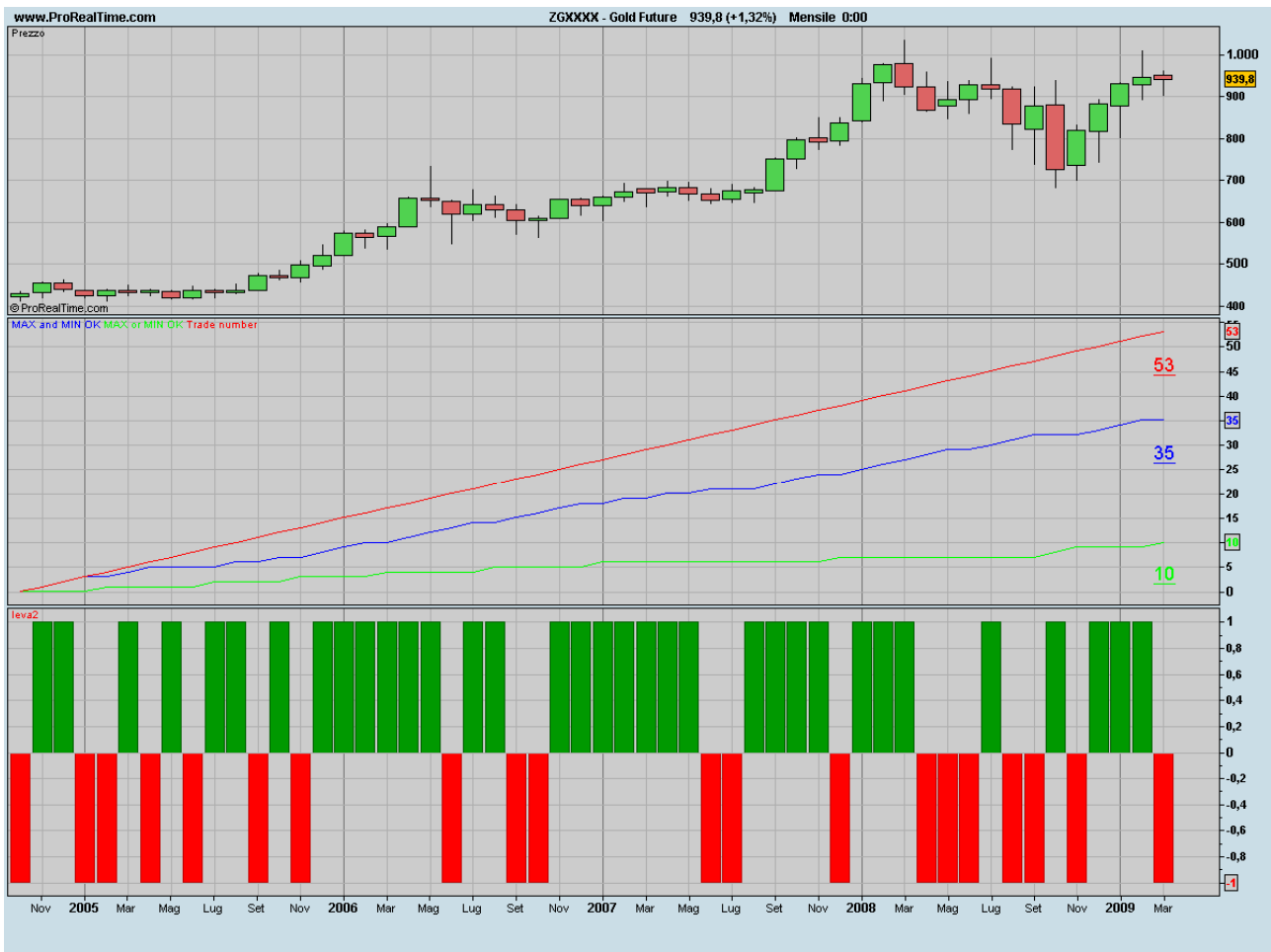
- la linea rossa indica il numero di mesi di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 53);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 35);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 10);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura mensile è superiore (istogramma verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva mensile.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

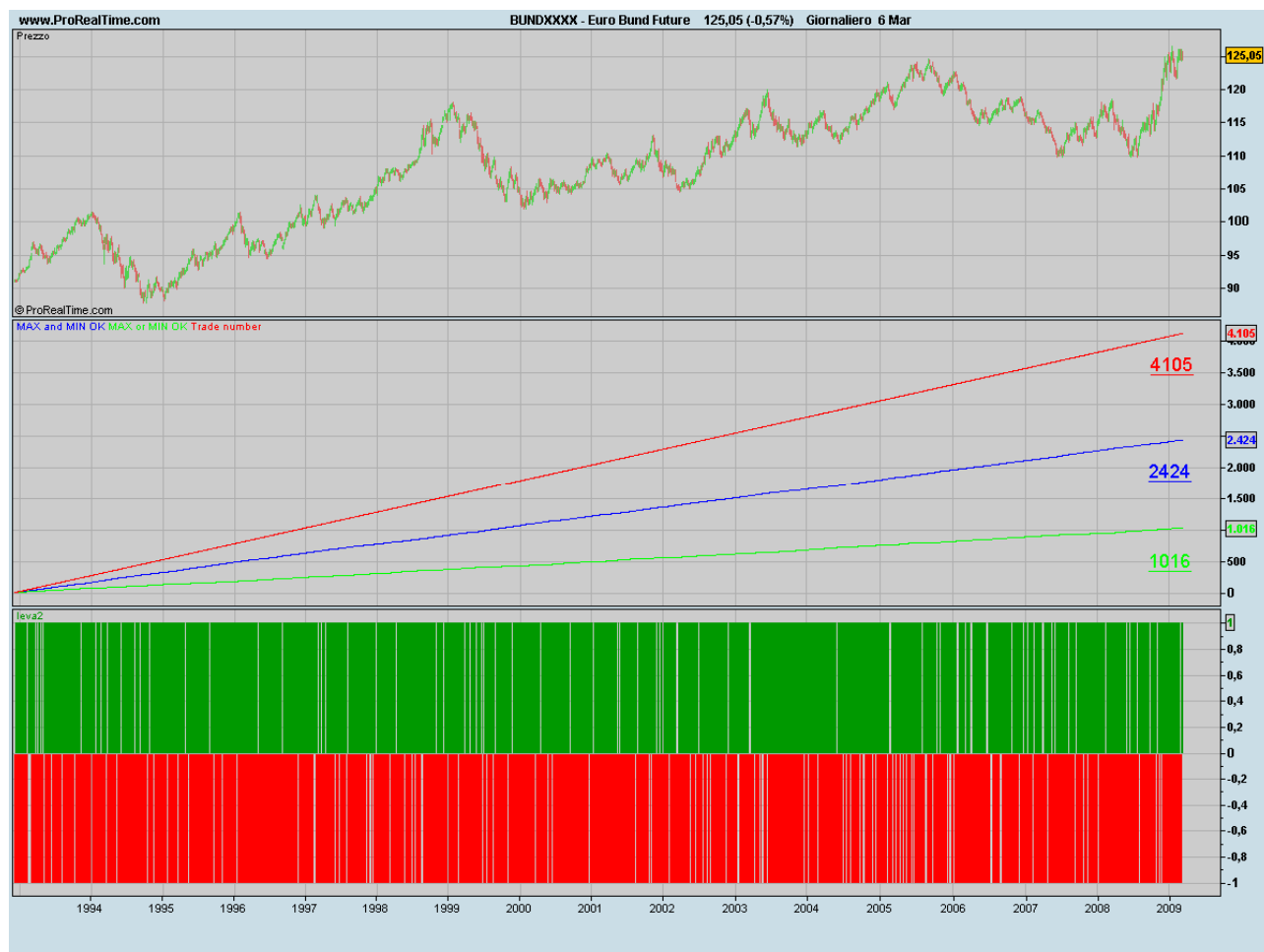
- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per il mese successivo, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 66% (35/53);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 19%;

in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 85%.



BUND FUTURE

GIORNALIERO



Nella figura precedente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni giornaliere del Bund Future dal 1993 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

- la linea rossa indica il numero di giorni di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 4105);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 2424);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 1016);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura giornaliera è superiore (istogramma

verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva giornaliera.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per il giorno successivo, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 59% (2424/4105);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 25%;

in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 84%.

SETTIMANALE

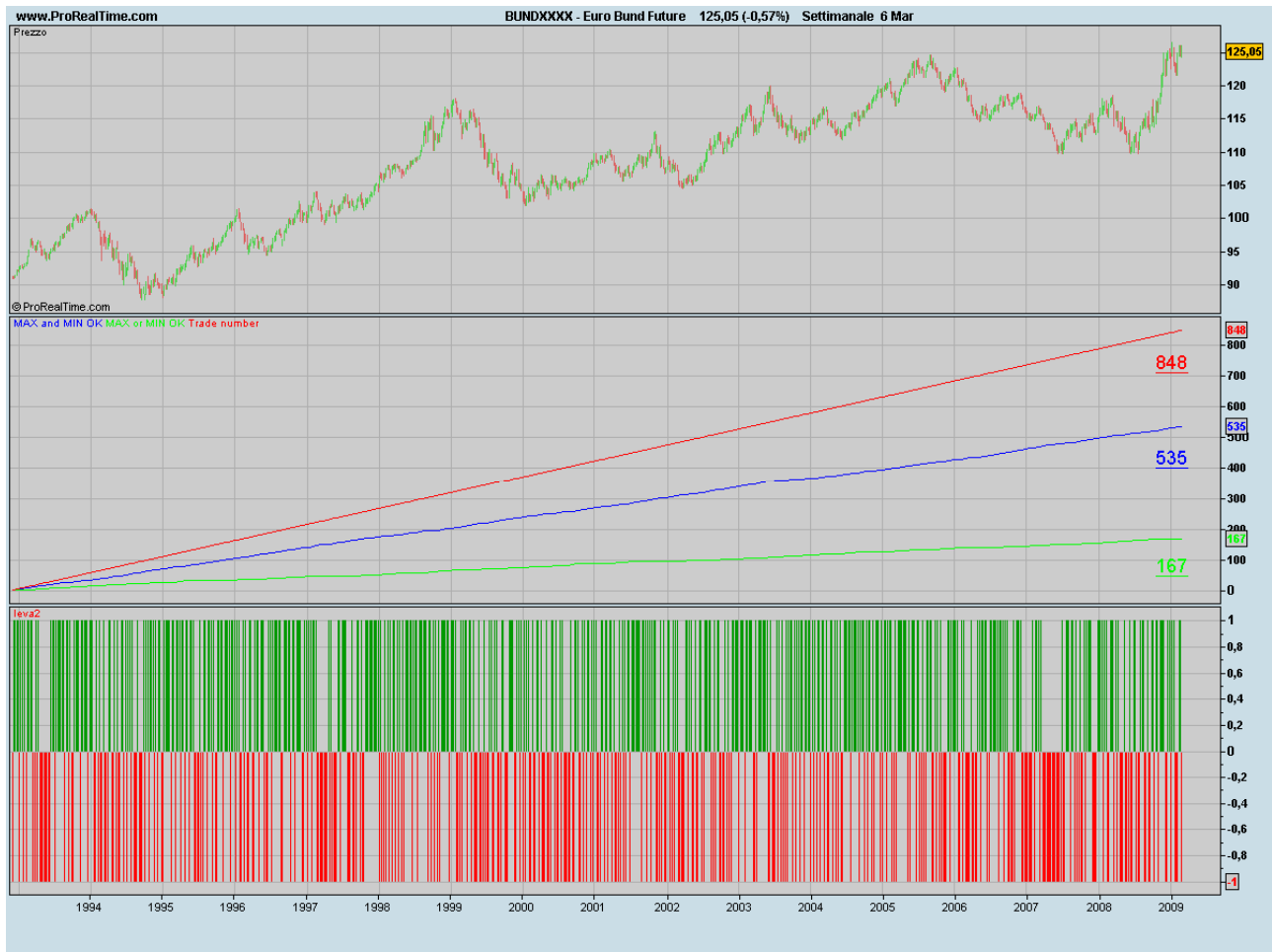
Nella figura seguente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni settimanali del Bund Future dal 1993 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

- la linea rossa indica il numero di settimane di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 848);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 535);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 167);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura settimanale è superiore (istogramma verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva settimanale.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per la settimana successiva, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 63% (535/848);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 20%;
- in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 83%.



MENSILE

Nella figura seguente nel pannello superiore sono mostrate le quotazioni mensili del Bund Future dal 1993 ai giorni nostri; nel pannello centrale 3 curve il cui significato è il seguente:

- la linea rossa indica il numero di mesi di borsa aperta (al 7 Marzo 2009, 195);
- la linea blu indica il numero di volte in cui sia per il massimo che per il minimo la previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 135);
- la linea verde indica il numero di volte in cui o solo per il massimo o solo per il minimo previsione basata sull'utilizzo della leva è stata corretta (al 7 Marzo 2009, 37);

nel pannello inferiore è mostrato quando la chiusura mensile è superiore (istogramma verde) o inferiore (istogramma rosso) alla leva mensile.

Dai numeri mostrati possiamo concludere che:

- nel caso in cui il Trading System indichi un massimo e un minimo superiore o inferiore per il mese successivo, la probabilità che entrambe le condizioni siano soddisfatte è del 69% (135/195);
- la probabilità, invece, che sia verificata una sola delle due condizioni è del 19%;

in totale, quindi, la probabilità che almeno una delle due condizioni è soddisfatta è del 88%.

MONEY MANAGEMENT

Un buon Trading System non puo' e non deve prescindere dalla ferrea applicazione delle regole di money management

Ecco siamo arrivati all'ultima parte di questo studio, forse la parte più importante. Vi riporto una frase di Larry Williams:

"La costruzione della ricchezza da parte dello speculatore, è il frutto di una corretta gestione del capitale (money management) piuttosto che il risultato dell'applicazione di formule magiche, sistemi misteriosi o di strane alchimie. Un trading corretto consente di guadagnare soldi, mentre un trading corretto unito ad una corretta gestione del denaro consente di accumulare una fortuna".

Ahimè, come sono vere queste parole. Ogni qualvolta che ho applicato ferreamente le regole del money management ai miei investimenti ho guadagnato tantissimi soldi, quando ho fatto il contrario, ho preso delle scoppole che ancora mi fanno leccare le ferite.

Questa è la formula di money management che quando ho utilizzato per il trading in azioni e derivati mi ha fatto guadagnare tantissimi soldi, quando non l'ho fatto, in preda a qualche illusione di stupidità ho perso tantissimi soldi:

Capitale Iniziale $x0,15/0,50$

Innanzitutto le spiegazioni:

0,15 rappresenta il 15% del capitale

0,50 lo stop dell'operazione (perdita massima del 50%)

Supponiamo che ho diecimila euro, quando devo investire nella prossima operazione?

Facciamo i calcoli :

$10.000,00 \times 0,15 / 0,50 = 3.000,00$ euro

Vi è chiaro? Nella prossima operazione devo investire al massimo tremila euro.

Supponiamo che su quest'operazione guadagno 500, allora il mio capitale diventa 10.500,00.

Quando devo investire sulla prossima operazione?

$10.500,00 \times 0,15 / 0,50 = 3.150,00$ euro

Supponiamo che su quest'operazione perdo 1.600,00 euro, e quindi il mio capitale diventa 9.000,00, quando devo investire nella prossima operazione?

$9.500,00 \times 0,15 / 0,50 = 2.850,00$ euro.

Se applicate sempre questa formula vi assicuro che guadagnerete sempre una barca di soldi, altrimenti sarete destinati a perdite colossali ed al fallimento. Basta avere un sistema di trading che funzioni almeno al 50%, e il sistema che vi abbiamo spiegato funziona più, molto di più del 50% delle volte...

Il Money management indicato sopra è ideale per un'operatività in opzioni, per il future vi consiglio questo Money management.

Nella tabella seguente è calcolato, partendo da un capitale iniziale di 10000 euro e un incremento costante di 3000 euro, il numero di contratti da acquistare, stiamo parlando di miniFIB, in funzione del capitale del momento.

Ad esempio fino a quando il capitale rimane sotto i 13000 euro, allora si opera con un solo contratto. Superati i 13000 euro si opera con 2 contratti, superati i 19000 euro con 3 contratti e così via.

È importante chiarire che se si sta operando con 3 contratti e a causa di un'operazione in perdita il capitale diventa inferiore ai 19000 euro, allora si torna ad operare con 2 contratti.

Capitale Iniziale Incremento costante

10000 3000

1 10000

2 13000

3 19000

4 28000

5 40000

6 55000

7 73000

8 94000

9 118000

10 145000
11 175000
12 208000
13 244000
14 283000
15 325000
16 370000
17 418000
18 469000
19 523000
20 580000
21 640000
22 703000
23 769000
24 838000
25 910000
26 985000
27 1063000
28 1144000
29 1228000
30 1315000
31 1405000
32 1498000
33 1594000
34 1693000
35 1795000

36 1900000

37 2008000

Nella tabella precedente abbiamo riportato il numero di contratti con i quali operare fino ad un capitale di 2008000 euro.

Vi deve essere chiaro che utilizzando il Money management, salvaguardate sempre i risultati raggiunti, o buona parte dei risultati raggiunti, e non mettete mai in gioco il capitale accumulato fino a quel momento.

COME SI UTILIZZA QUESTO TRADING SYSTEM CON EXCEL?

Il Software è applicabile ai seguenti Time Frame:

orario, giornaliero, settimanale e mensile.

Primo Step

Inserire OMISSIS del Time Frame considerato

<i>Time Frame</i>	
<i>OMISSIS</i>	<i>OMISSIS</i>

Secondo Step

Dopo aver inserito i dati, il Software elabora il Segnale (LONG O SHORT) e a secondo della Tendenza futura, il prezzo del futuro Massimo o del futuro Minimo

<i>Segnale</i>
<i>SHORT</i>

<i>Segnale</i>
<i>LONG</i>

<i>Massimo Previsto</i>
<i>28077,26</i>

Minimo Previsto

27000,26

Ottenuti i dati della proiezione di Tendenza e del prezzo (del massimo o del minimo a seconda della Tendenza), si devono applicare le regole operative.

CONCLUSIONI

Il Trading System spiegato in queste pagine è potentissimo, ma nello stesso momento di una semplicità disarmante: bisogna solo applicarlo SEMPRE per ottenere dei risultati strabilianti.

Che la Vita vi Sorrida SEMPRE

Lo Staff di Proiezionidiborsa