

26-dic-2017

Oggi i principali Mercati Europei sono chiusi. Farò un breve report incentrato sui Mercati Usa (S&P500-Nadaq-Dow Jones) ed Eur/Usd.

In generale i bassi Volumi e le festività per molti Mercati potrebbero ridurre i potenziali movimenti su tutti i Mercati.

Chiusura Borse Asia/Pacifico (ore 9:00):

Giappone (Nikkei225)	-0,20%
Australia (Asx All Ordinaries)	chiuso
Hong Kong (Hang Seng)	chiuso
Cina (Shangai)	+0,78%
Taiwan (Tsec)	+0,46%
India (Bse Sensex):	-0,96%

L'effetto generale per l'inizio della mattinata sui mercati Europei (tenendo conto dei pesi e delle correlazioni dei vari Indici Asiatici) è da considerarsi Neutrale.

Come orari con Eventi (da me selezionati) che ritengo di rilievo per oggi:

Questa notte il dato dell'Inflazione (prezzi al Consumo) del Giappone è stato poco sopra le attese.

Per oggi l'unico dato di rilievo è la Fiducia Consumatori Usa (ore 16).

Vediamo ora i 4 future su Indici Azionari Usa e Eur/Usd per valutare soprattutto il Ciclo Settimanale - dati a 15 minuti a partire dall'8 dicembre e aggiornati alle ore 11:40 di oggi 26 dicembre- la retta verticale rappresenta l'inizio di tale ciclo:



Gli Indicatori Ciclici in figura (rappresentativi del Ciclo Settimanale) sono al ribasso per tutti i Mercati Usa.

Analizziamo ora il **ciclo Settimanale** – è partito il 15 dicembre mattina e resta in buona forza per il mercato Usa. Sui minimi del 21 dicembre mattina (vedi freccia blu) siamo arrivati a metà ciclo. Ora potremmo avere 1 gg di equilibrio (lateralità)- poi mancherebbe 1 gg di leggero indebolimento per andare a chiudere.

Prezzi “critici” da monitorare (tenendo conto dei fattori tempo, volumi e strutture cicliche e quindi possono variare di giorno in giorno):

- una leggera prevalenza rialzista può portare a:

- miniS&P500: 2692-2700-2710
- miniNasdaq: 6500-6530 -6550
- miniDJ: 24815-24860-24900

Valori verso il 1° sottolineato ci direbbero di un Settimanale in ripresa di forza e che si potrebbe allungare.

- dal lato opposto una leggera correzione può portare a:

- miniS&P500 (situazione differente): 2680-2670-2660
- miniNasdaq: 6460-6430-6400
- miniDJ: 24700-24620-24530

Valori sino al 1° scritto sopra sono “natural” correzioni- valori verso il 1° sottolineato ci direbbero di un Settimanale in indebolimento.

Vediamo ora la situazione Multi-Ciclica per il miniS&P500 future e che vale anche per gli altri Indici Azionari (dati aggiornati alle ore 11:40 di oggi 26 dicembre):



Valutiamo i Cicli secondo il metodo multi Ciclico. Questa valutazione parte dai Cicli più lunghi (trend principale) e poi osserva con la lente di ingrandimento cosa potrebbe accadere a livello intraday- le valutazioni delle forze in atto sui vari Cicli sono principalmente focalizzate sulla giornata odierna.

- in alto a sx c'è il metà-Trimestrale oppure Mensile (detto Tracy+2 -dati a 15 minuti) – per il mercato Usa sembra partito in tempi idonei un nuovo Mensile sui minimi del 14 dicembre sera (o 15 mattina, ma cambia poco). Potremmo avere una prevalenza rialzista sino a fine anno- poi si valuterà.

- in basso a sx c'è il Ciclo Settimanale (o Tracy -dati a 15 minuti) – è partito il 14 dicembre sera (o 15 dicembre mattina) e resta in forza. Più sopra ho spiegato le sue potenzialità e non mi ripeto.

- in alto a dx c'è il Ciclo bi-Giornaliero (o Tracy-2 -dati a 5 minuti- è un ciclo meno importante) – è partito il 21 dicembre intorno alle ore 09:30 ed ha perso forza. Non è chiaro se sia terminato il 22 dicembre pomeriggio (vedi freccia gialla) o se possa proseguire. Comunque è atteso un avanzamento senza particolare forza.

- in basso a dx c'è il Ciclo Giornaliero (o Tracy-3 -dati a 5 minuti) - sembra partito venerdì intorno alle ore 17:30 e non ha forza. Potrebbe proseguire senza forza sino alla sua conclusione attesa entro le ore 18. A seguire un nuovo Giornaliero atteso leggermente debole.

Vediamo le strategie intraday che Io utilizzo in base alle conformazioni cicliche potenziali attuali:

Trade Rialzo	Acquisto sopra	Take-Profit (punti)	Stop-Loss sotto
miniS&P500	2692	2,25-2,5	2690
miniNasdaq	6500	6-6,5	6495

miniDJ	24815	21-23	24795
---------------	-------	-------	-------

Trade Ribasso	Vendita sotto	Take-Profit (punti)	Stop-Loss sopra
miniS&P500-1	2680	2,25-2,5	2682
miniS&P500-2	2675	2,75-3	2677,5
miniNasdaq	6460	6-6,5	6465
miniDJ	24700	21-23	24720

Avvertenza.: leggere attentamente le Regole di Trading che Io utilizzo

Ricordo che per valutare un metodo di Trading bisogna vedere tutti i segnali ogni giorno, e non solo saltuariamente o quando ciascheduno lo ritenga opportuno.

Vediamo anche il grafico per Euro/Dollaro - dati a 15 minuti a partire dall'8 dicembre ed aggiornati alle ore 11:40 di oggi 26 dicembre- la retta verticale rappresenta l'inizio del ciclo Settimanale:



Euro/Dollaro

- Ciclo Settimanale – è partito sui minimi del 12 dicembre pomeriggio. Sembra terminato sui minimi del 22 dicembre (vedi freccia blu)- in tal caso potremmo avere 3 gg di leggera prevalenza rialzista. Chiaramente discese verso i minimi del 22 dicembre porterebbero ad un allungamento del ciclo precedente (fatto per ora non preventivabile).

- Ciclo Giornaliero – sembra partito venerdì intorno alle ore 16:30. Se fossimo in un nuovo Settimanale potremmo avere una prevalenza rialzista.

A livello di Prezzi “critici” da monitorare:

- una leggera forza può portare a 1,1875-1,1900 cosa che confermerebbero un nuovo Settimanale;
- dal lato opposto possono esservi correzioni verso 1,1840- valori inferiori a 1,1820 ci direbbero di un Settimanale che si allunga. Oltre abbiamo 1,1800.

Come livelli di Trading Intraday che io utilizzo in base a quanto vedo ora abbiamo:

Eur/Usd	Acquisto sopra	Take-Profit (punti)	Stop-Loss sotto
----------------	-----------------------	----------------------------	------------------------

<u>Trade Rialzo-1</u>	1,1875	0,0011-0,0012	1,1865
<u>Trade Rialzo-2</u>	1,1900	0,0011-0,0012	1,1890
	<u>Vendita sotto</u>	<u>Take-Profit</u>	<u>Stop-Loss sopra</u>
<u>Trade Ribasso-1</u>	1,1845	0,0011-0,0012	1,1855
<u>Trade Ribasso-2</u>	1,1825	0,0011-0,0012	1,1835

Operatività in OPZIONI, Etf, Spread su vari mercati (operatività che personalmente sto seguendo)

- Nulla da aggiungere a quanto scritto nel report del fine settimana.

- Per l'**Eur/Usd**, ho operazioni rialziste con prezzo medio 1,76. Ora attendo, ma per valori oltre 1m193 chiuderei in utile metà posizione.

Mi sono rimaste anche metà posizioni rialziste in Opzioni con Vertical Call debit Spread (uso quelle quotate al Cme con sottostante il future Eurodollaro) - acquisto Call marzo 1,160-vendita Call marzo 1,170. Per valori oltre 1,193 chiuderei in utile le rimanenti.

Per il Trading ricordo le 10 regole generali che adotto per la Mia operatività:

1- I Prezzi di Ingresso sono la parte più importante della tabella – questi (e gli Stop-Loss) sono più corretti alla rottura dei prezzi scritti sopra e non sui prezzi scritti sopra – per rottura si intende 1 o 2 tick sopra (acquisto) o sotto (vendita)

2- I Prezzi di ingresso restano Validi per la giornata fino a quando non viene toccato lo Stop-Loss- dopo le ore 19 meglio non operare su Eurostoxx-Dax-Bund a meno che non si abbiano posizione aperte in precedenza e che **comunque vanno chiuse a fine giornata**

3- Se si verificano per es. prima i Segnali Rialzisti, quelli Ribassisti restano validi (per la giornata) a meno che si sia arrivati al Take-Profit del segnale Rialzista- la stessa cosa vale se si verificano prima i segnali Ribassisti

4- Come gestione della Posizione, quando scrivo Take-Profit 10-15 (es. Eurostoxx) significa che arrivati ad un utile di 10 punti o si esce dal Trade o perlomeno si alza lo stop a pareggio (ovvero a livello di ingresso)- al raggiungimento di un utile di 15 punti o si esce (ma chi ha delle sue regole di profit dinamiche, e quindi basate sul movimento dei prezzi, può rimanere ancora nel trade) o comunque si mette uno stop profit a 10 punti

5- Le rotture di livelli di Prezzi di Ingresso sui vari mercati in tempi vicini si auto confermano

6- Talvolta su alcuni trade non c'è proporzione tra Take-Profit e Stop-Loss, ma se li metto significa che sono gli unici stop-loss statici che mi sento di dare in base a quanto vedo in quel momento su base ciclica- se si considerano troppo elevati gli Stop-Loss non si opera, oppure si usano Stop-Loss proporzionali ai Take-Profit (ma si rischia di più in termini di probabilità che lo stop-loss venga preso)

7- I migliori Stop-Loss e soprattutto Take Profit sono dinamici e non statici

8- Bisogna anche tenere conto di potenziali false rotture negli orari di uscita di dati sensibili (segnalati sempre all'inizio del Report)

9- Per diminuire il rischio sarebbe meglio operare almeno su 2 dei precedenti mercati più 1 tra Euro/Dollaro e Bund

10- Talvolta, malgrado la visione della giornata si più rialzista (o ribassista), metto più livelli di trading nella direzione opposta- ciò non è un controsenso, ma spesso sono livelli che se superati negherebbero la lettura ciclica prevalentemente rialzista (o ribassista) preventivata. Inoltre, soprattutto su forti movimenti direzionali, sono più chiari i livelli di prezzo nella direzione opposta.

Aggiungo che per valutare i risultati dei miei segnali non ha senso vederli solo per qualche giorno, ma come qualsiasi tecnica di trading va valutata con continuità su una serie di segnali forniti e sui vari mercati. Chiaramente ci sono dei momenti di perdita (quando i cicli sono meno chiari), ma spesso le giornate si chiuderebbero in pareggio (o quasi) seguendo i segnali rialzisti e poi quelli ribassisti (o viceversa) sullo stesso mercato. Quando vi è poi una sequenza di operazioni positive si punta a recuperare e a guadagnare.

Per quanto riguarda l'Operatività in Opzioni che scrivo (che è parte di quella che effettivamente faccio), i prezzi dell'esecuzione (rispetto ai miei) possono differire di molto in funzione di: valore del sottostante, volatilità, tempo alla scadenza. Ciò porta inevitabilmente ad una struttura di rendimento/rischio differente. Anche le uscite dai Trade in Opzioni a volte devono essere tempestivi e se non si riesce a essere rapidi (perché non si segue sempre il mercato) si perdono opportunità di buone uscite in profit (ma anche in stop-loss).