

11-mag-2018

Faccio un report veloce mentre sono al TradingTech Siat.

Borse Asia/Pacifico:

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 importanti per oggi:

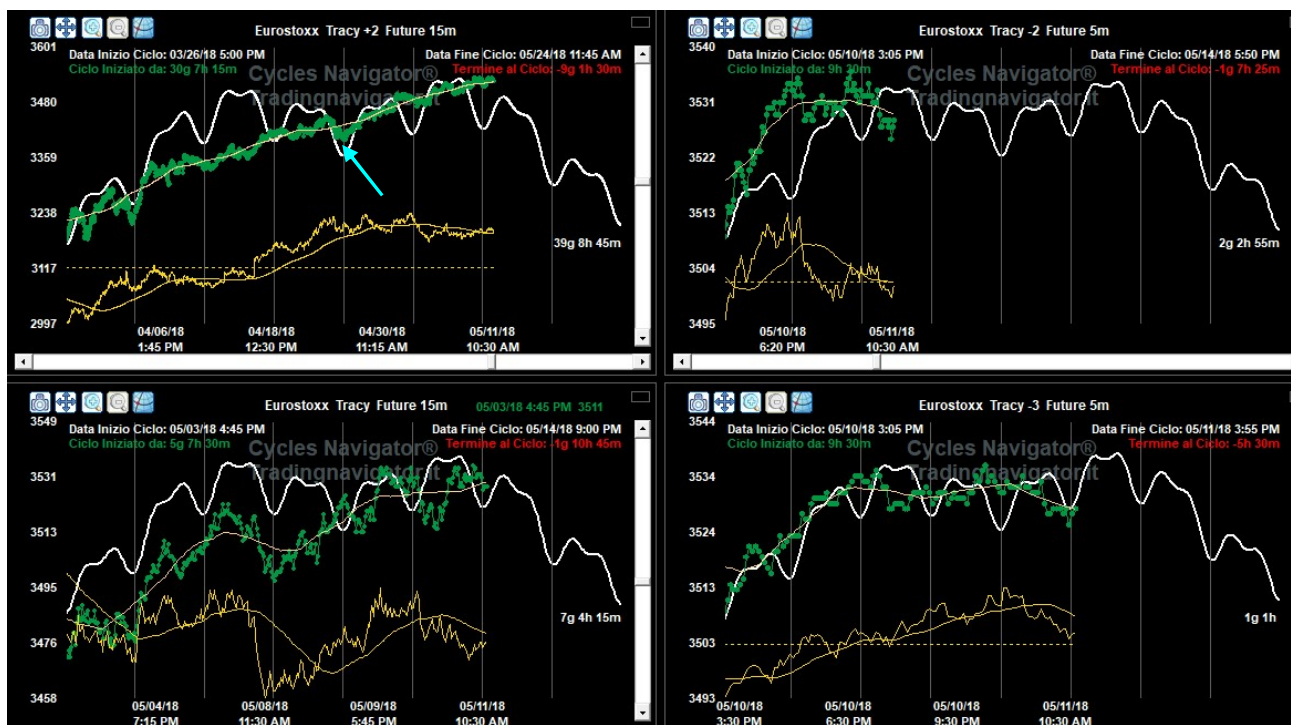
Questa notte il dato sul Conto Corrente del Giappone è stato poco sopra le attese.

Il dato dell'Inflazione in Cina è stato poco sotto le attese.

<u>Ora</u>	<u>Dato</u>	<u>Rilevanza</u>
Ore 14:30	Indice Prezzi Import/Export Usa	<u>1</u>
Ore 16:00	Indice Fiducia Università Michigan	<u>1</u>

Fornisco questi Eventi ed i rispettivi orari (selezionati da me tra i molti che vi sono giornalmente) poiché nelle loro vicinanze potrebbero esserci movimenti decisi di prezzi ed eventuali false rotture di livelli critici di prezzo (di cui tenere conto nel Trading Intraday).

Vediamo ora la situazione Multi-Ciclica per l'Eurostoxx future e che vale anche per gli altri Indici Azionari (dati aggiornati alle ore 10:30 di oggi 11 maggio):



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) – sembra partito un Mensile il 25 aprile per l'Europa (vedi freccia ciano)- pertanto in figura sarebbe rappresentato un doppio Mensile. Per il miniS&P500 sembra una metà Trimestrale partito il 2

aprile. Le strutture cicliche tra Europa ed Usa si sono separate, cosa che rende più complessa l'interpretazione.

Nel breve ci potrebbe essere per entrambi i mercati una prevalenza rialzista sino alla fine della prossima settimana. A seguire un leggero indebolimento per andare a chiuder il Mensile (Europa) ed il metà-Trimestrale (Usa). Tuttavia restano dei dubbi per il fatto che la separazione ciclica sia così netta.

- in basso a sx c'è il Ciclo Settimanale (o Tracy -dati a 15 minuti) – è partita una nuova fase sui minimi del 3 maggio. Mancherebbero 1-2 gg di indebolimento per la conclusione ciclica.

- 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 10 maggio pomeriggio- è atteso un suo indebolimento.

- in basso a dx c'è il Ciclo Giornaliero (o Tracy-3 -dati a 5 minuti) – è partito ieri intorno alle ore 15:00 e sta perdendo forza. Potrebbe rimanere debole per trovare un minimo conclusivo entro le ore 16:00. A seguire un nuovo Giornaliero atteso a leggera prevalenza ribassista.

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

Trade Rialzo	Acquisto sopra	Take-Profit (punti)	Stop-Loss sotto
Eurostoxx-1	3536	8-9	3529
Eurostoxx-2	3550	9-10	3542
Dax-1	13040	16-18	13025
Dax-2	13100	21-23	13080
Fib-1	23780	45-50	23740
Fib-2	23870	55-60	23820
miniS&P500-1	2725	3,25-3,5	2722
miniS&P500-2	2735	3,25-3,5	2732

Trade Ribasso	Vendita sotto	Take-Profit (punti)	Stop-Loss sopra
Eurostoxx-1	3510	9-10	3518
Eurostoxx-2	3495	9-10	3503
Dax-1	12960	16-18	12975
Dax-2	12925	21-22	12945
Fib-1	23470	45-50	23510
Fib-2	23400	55-60	23450
miniS&P500-1	2712	3,25-3,5	2715
miniS&P500-2	2700	3,25-3,5	2703

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

Euro/Dollaro

- Ciclo Settimanale – sembra partito sul minimo del 9 maggio mattina. Potrebbe avere 1-2 gg di rimbalzo.

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
Trade Rialzo-1	1,1950	0,0013-0,0014	1,1938
Trade Rialzo-2	1,1200	0,0014-0,0015	1,1987
	Vendita sotto	Take-Profit	Stop-Loss sopra

<u>Trade Ribasso-1</u>	1,1870	0,0014-0,0015	1,1883
<u>Trade Ribasso-2</u>	1,1820	0,0014-0,0015	1,1833

Bund future

- Ciclo Settimanale – è partita un po' a sorpresa una nuova Settimanale sui minimi del 3 maggio mattina. Il minimo a V del 9 maggio sarebbe la metà ciclo. Ora si potrebbe perdere forza soprattutto dal pomeriggio.

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

<u>Bund</u>	<u>Acquisto sopra</u>	<u>Take-Profit (punti)</u>	<u>Stop-Loss sotto</u>
<u>Trade Rialzo-1</u>	159,42	0,08-0,09	159,35
<u>Trade Rialzo-2</u>	159,55	0,09-0,10	159,47
	<u>Vendita sotto</u>	<u>Take-Profit</u>	<u>Stop-Loss sopra</u>
<u>Trade Ribasso-1</u>	158,75	0,09-0,10	158,83
<u>Trade Ribasso-2</u>	158,50	0,09-0,10	158,58

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 in genere preferisco non operare su Eurostoxx-Dax-Bund a meno che non si abbiano posizioni aperte in precedenza e che **comunque chiudo a fine giornata**
- 3- Se si verificano per es. prima i Segnali Rialzisti, quelli Ribassisti li ritengo 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 10-11 (es. Eurostoxx) significa che arrivati ad un utile di 10-11 punti o esco dal Trade o perlomeno alzo lo stop a pareggio (ovvero a livello di ingresso)- eventualmente attendo un utile di massimo il 20-30% in più (nell'esempio significa al limite che esco a 13-14 punti). Chiaramente vi sono delle regole di profit dinamiche (e quindi basate sul movimento dei prezzi) che consentirebbero gestioni più precise della posizione, ma in quanto dinamiche (e quindi mutevoli) non le posso scrivere su un report;
- 5- Le rotture di livelli di Prezzi di Ingresso sui vari mercati (mi riferisco ai futures su indici azionari) 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 fissare in base a quanto vedo in quel momento su base ciclica;
- 7- I migliori Stop-Loss e soprattutto Take Profit sono dinamici e non statici (come detto più sopra);
- 8- Tendo anche conto di potenziali false rotture negli orari di uscita di dati sensibili (segnalati sempre all'inizio del Report);
- 9- Per diminuire il rischio cerco di operare almeno su 2 dei precedenti mercati più 1 tra Euro/Dollaro e Bund;
- 10- Al di là della visione della giornata più rialzista (o ribassista), fisso più livelli di trading nelle 2 direzioni opposte- 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 nella mia operatività chiaramente vi sono dei momenti di perdita (quando i cicli sono meno chiari)- comunque talvolta le giornate si chiudono in pareggio (o quasi) proprio perché i cicli

mi consentono di fare dei trade in direzione opposta. Quando vi è poi una sequenza di operazioni positive recupero le fasi di perdita e vado in guadagno.

Per quanto riguarda l'Operatività in Opzioni che scrivo (che è parte di quella che effettivamente faccio), i prezzi di esecuzione sono molto rilevanti (ovvero la tempestività di esecuzione). Anche le uscite dai Trade in Opzioni a volte devono essere tempestive- senza tale tempestività posso perdere opportunità di buone uscite in profit (ma anche in stop-loss).