

Mercati che tempo che fa

ITForum
2012

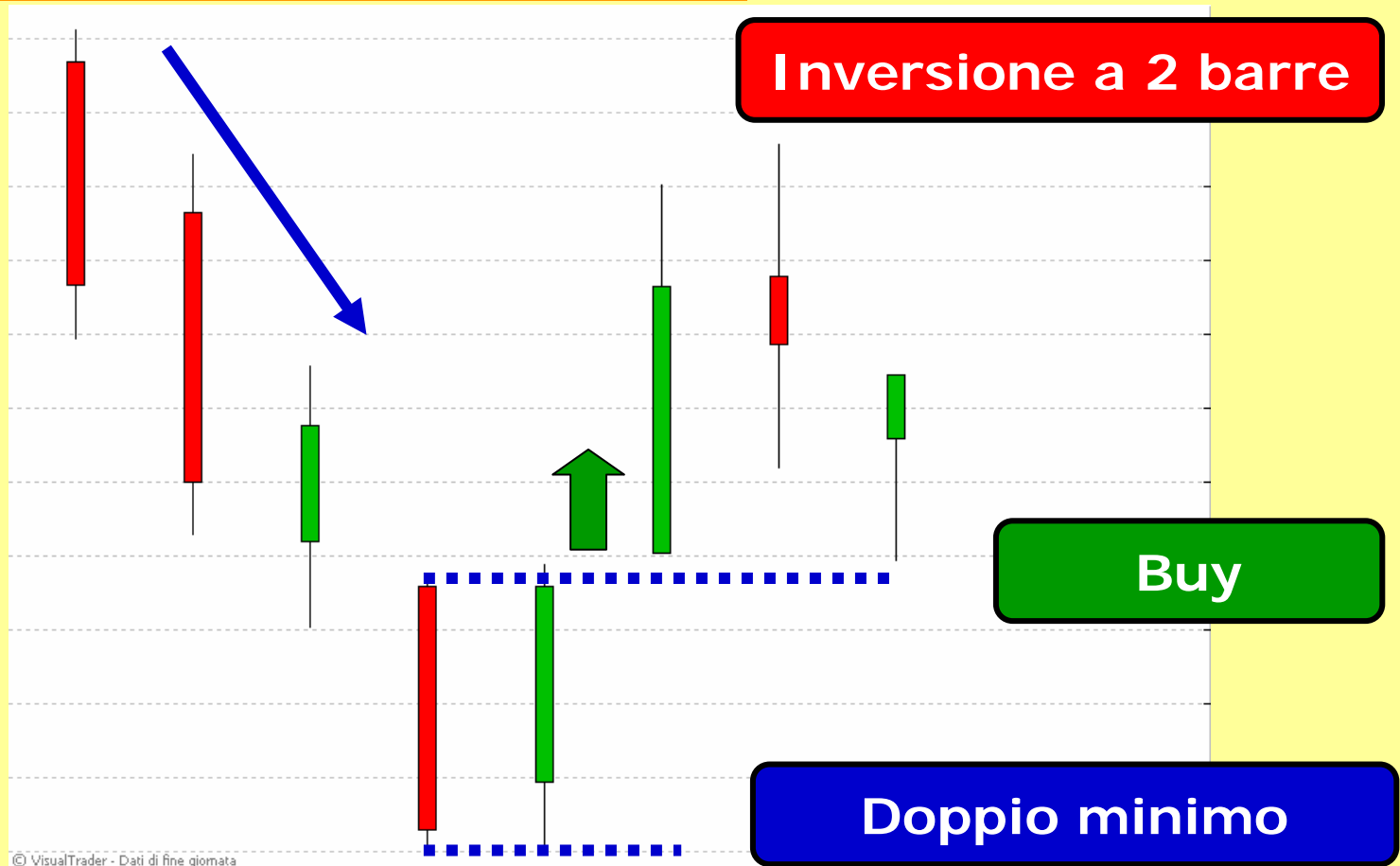
STAND
IWBANK



Maurizio Mazziere

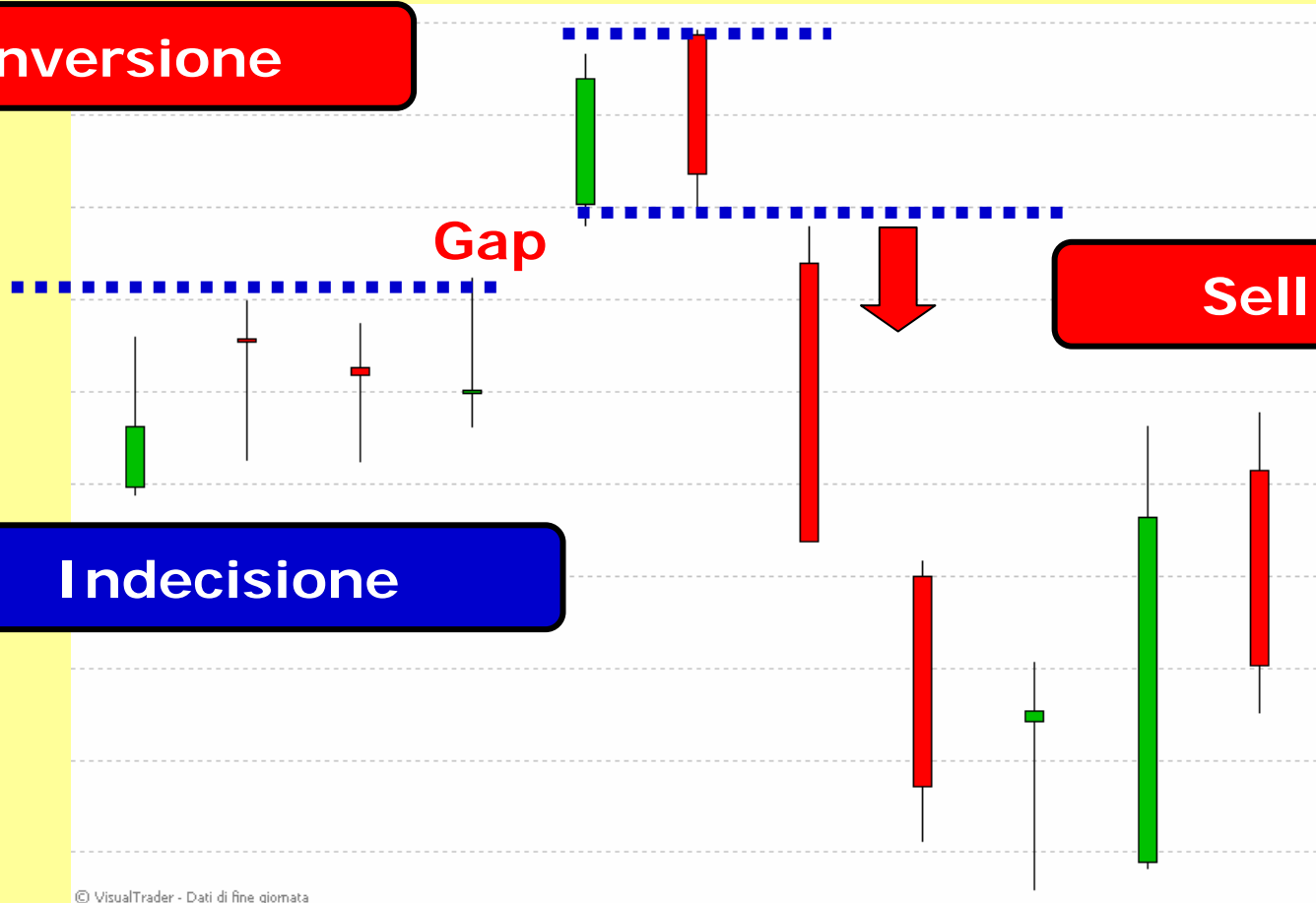
Copyright ©2012 – Tutti i diritti riservati

Pattern e setup operativi



Pattern e setup operativi

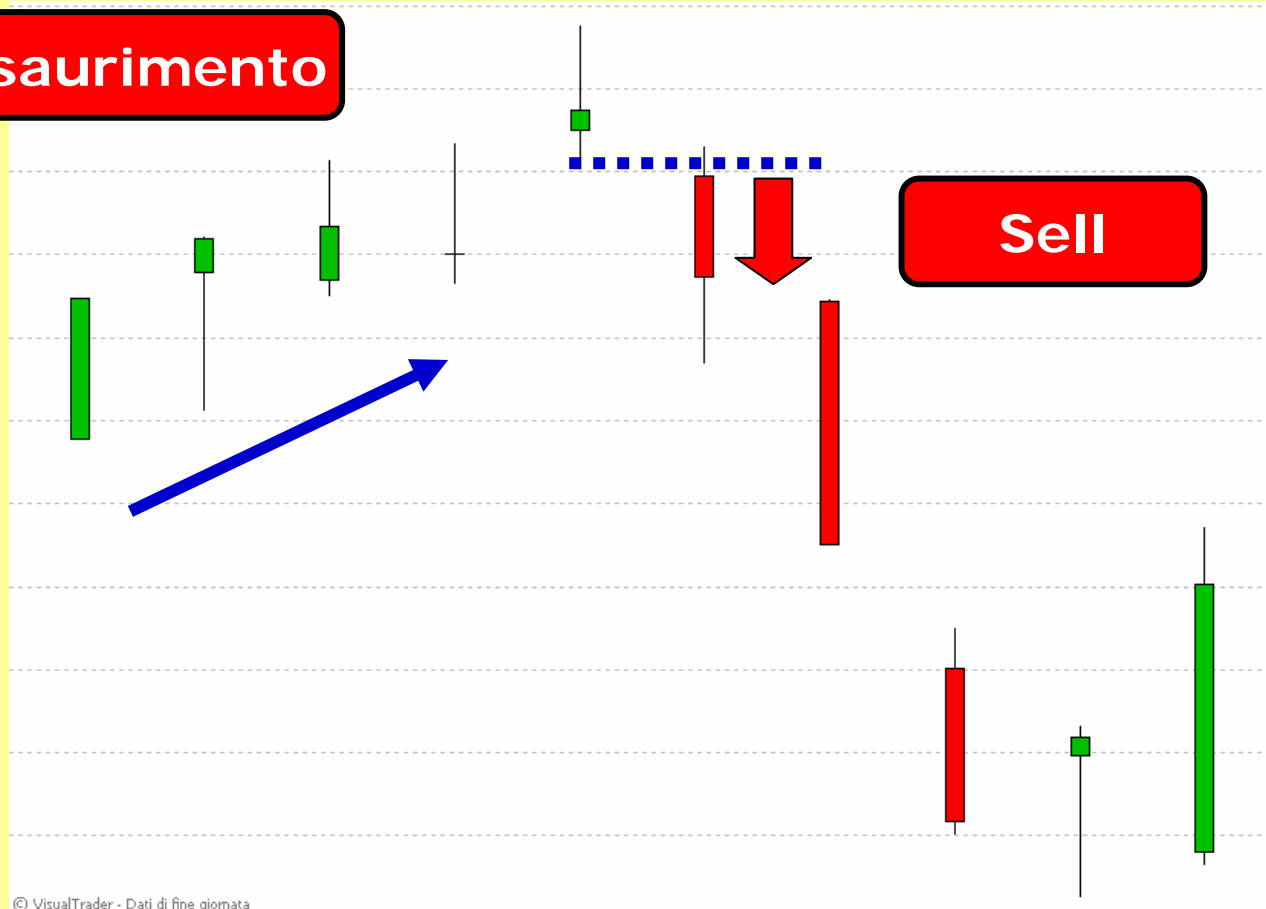
Inversione



© VisualTrader - Dati di fine giornata

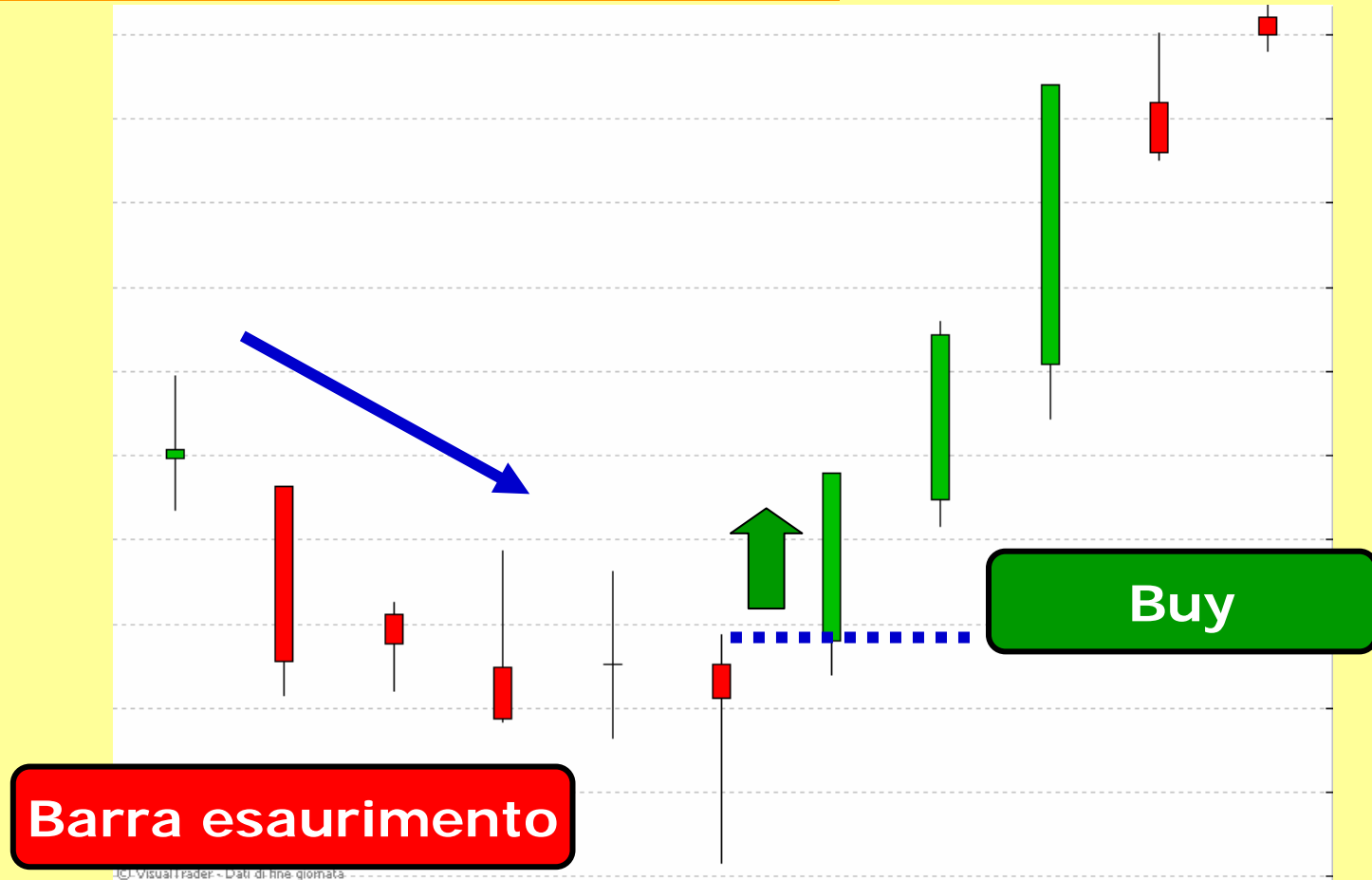
Pattern e setup operativi

Barra esaurimento



© VisualTrader - Dati di fine giornata

Pattern e setup operativi

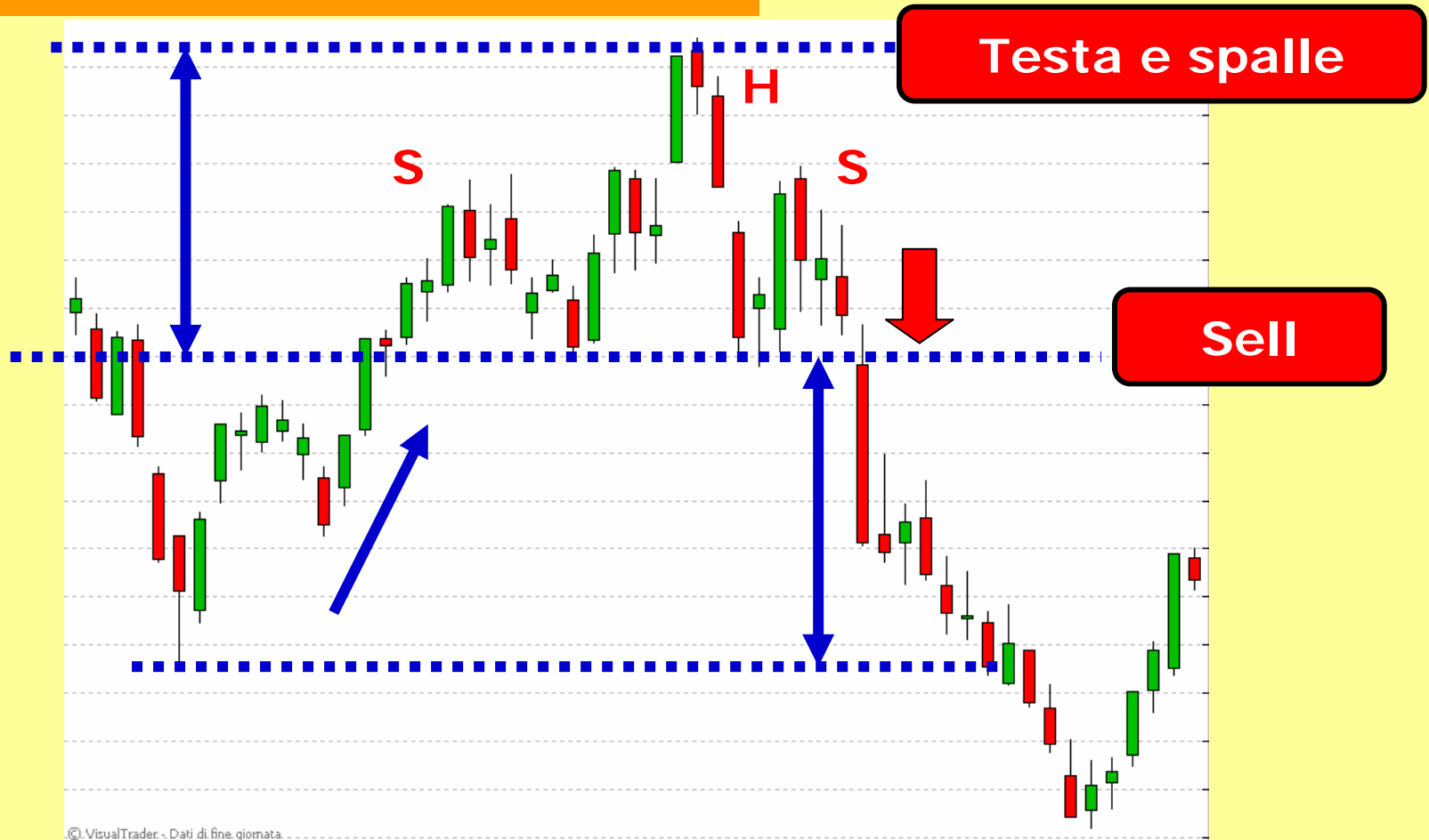


Pattern e setup operativi



© VisualTrader - Dati di fine giornata

Pattern e setup operativi



Money management

Le regole d'oro

Future

Contenere i margini
al 30% del conto

Non perdere oltre il 5%
del capitale in ogni operazione

Azioni

Non perdere oltre l'1-2%
del capitale in ogni operazione

Dimensionamento posizione

Max perdita

Capitale x 1%

es. 50.000€ x 1% = 500€

Dimensione

Max perdita / distanza stop

es. 500€ / 10% = 5.000€

Azioni e livello stop

Numero azioni

Dimensione / Prezzo azione

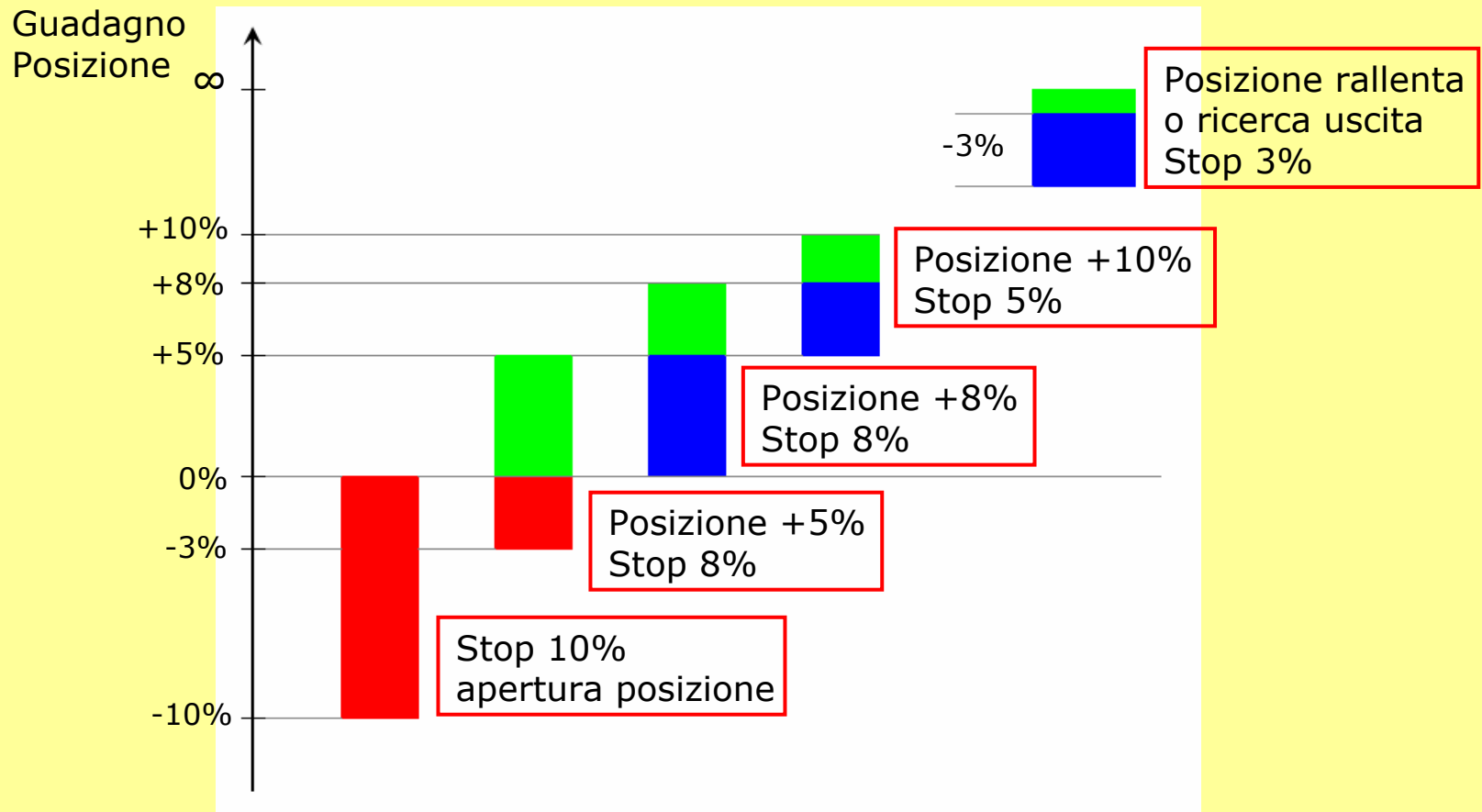
es. $5.000\text{€} / 2,5\text{€} = 2.000$

Livello stop

Prezzo azione - % stop

es. $2,5\text{€} - 10\% = 2,25\text{€}$

Stop e trailing percentuali



Strategia stop loss di volatilità

Chandelier

Long
Max periodo – Factor x ATR

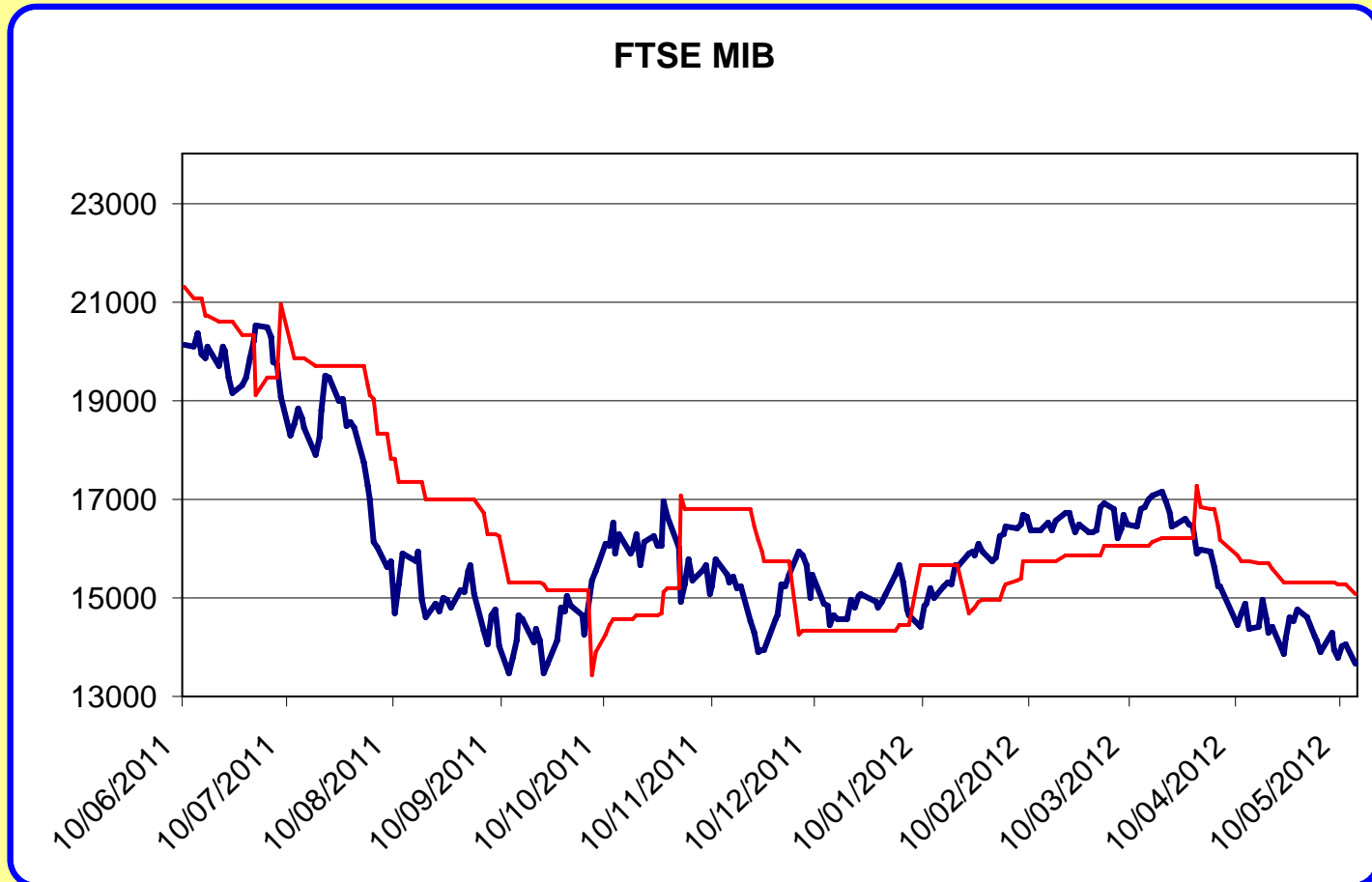
Short
Min periodo + Factor x ATR

Dev.Standard Stop

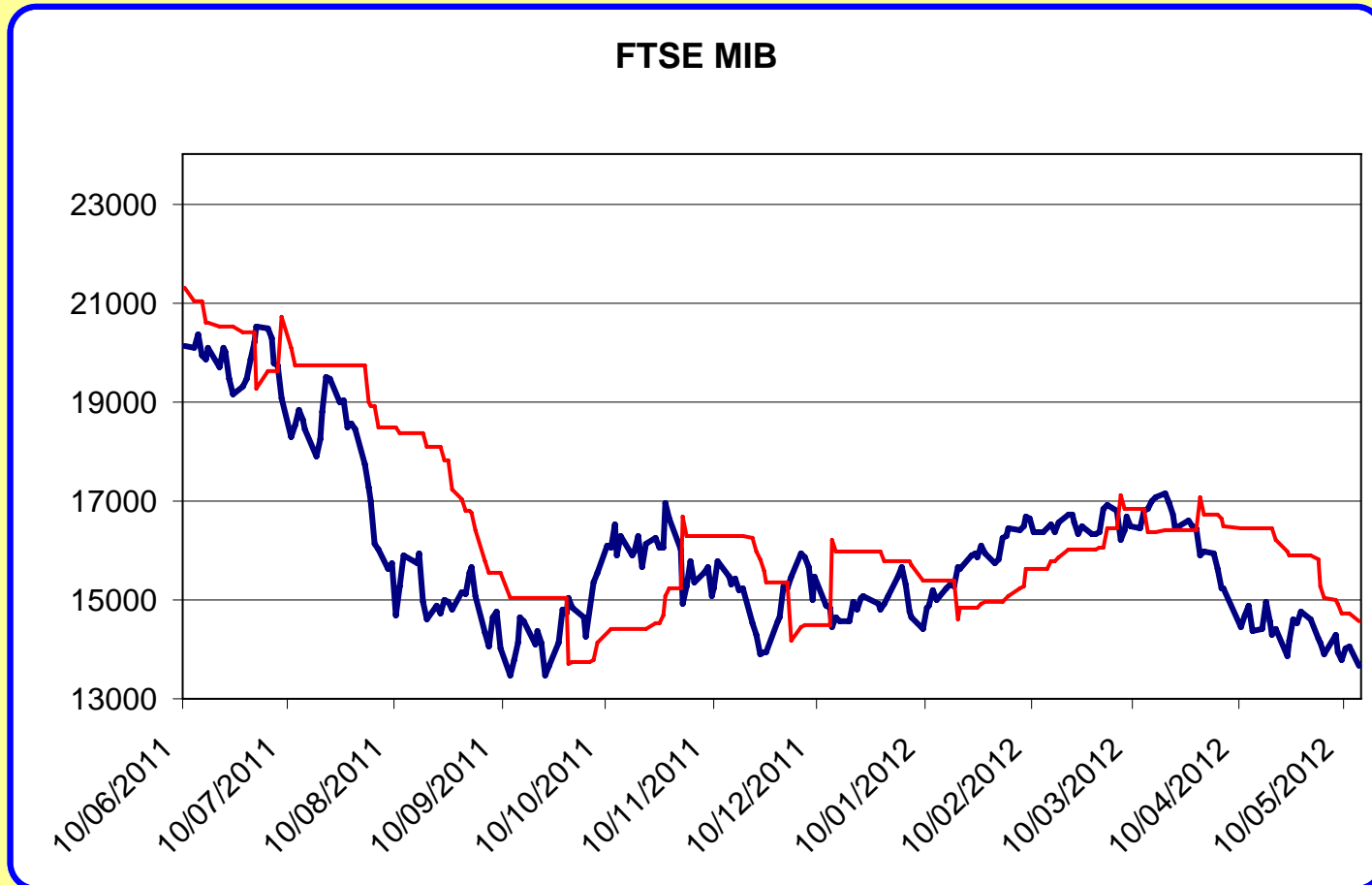
Long
Max periodo – 2 Dev.Standard

Short
Min periodo + 2 Dev.Standard

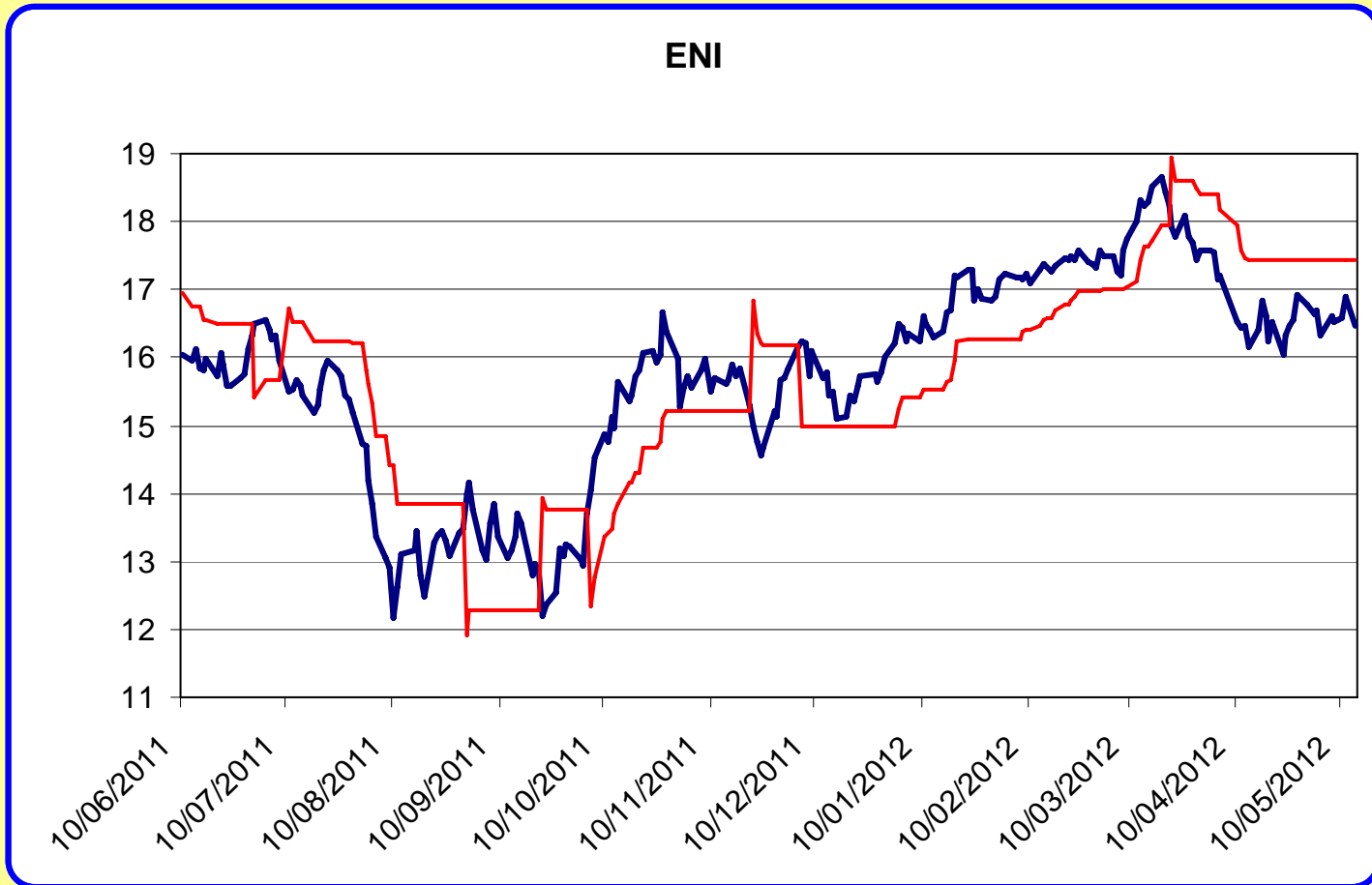
Chandelier: FTSE MIB



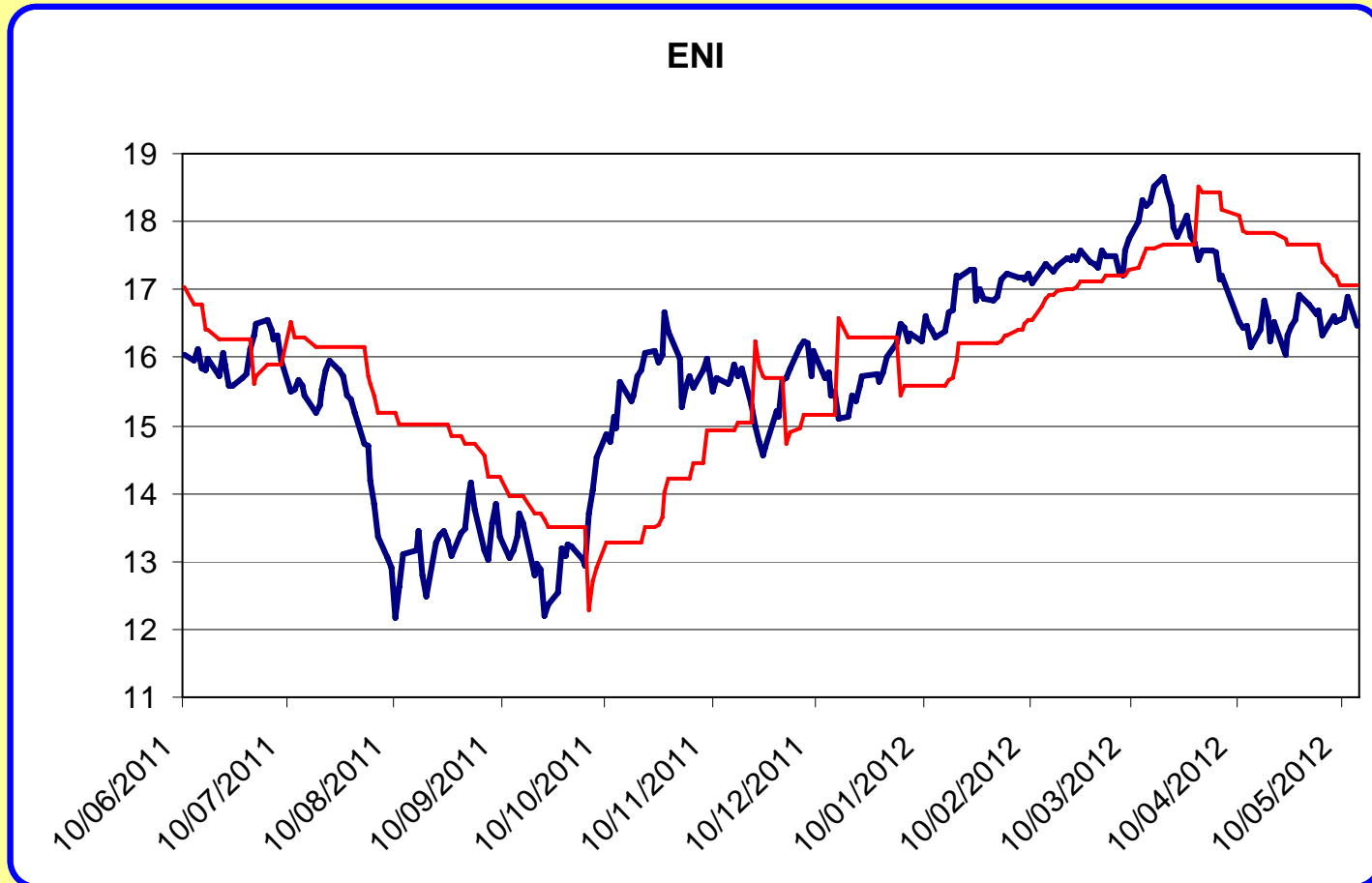
Dev. Std.: FTSE MIB



Chandelier: ENI

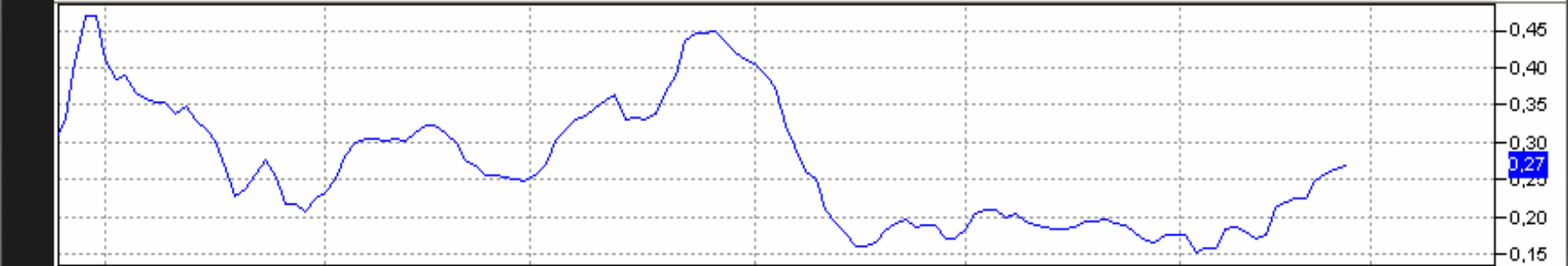
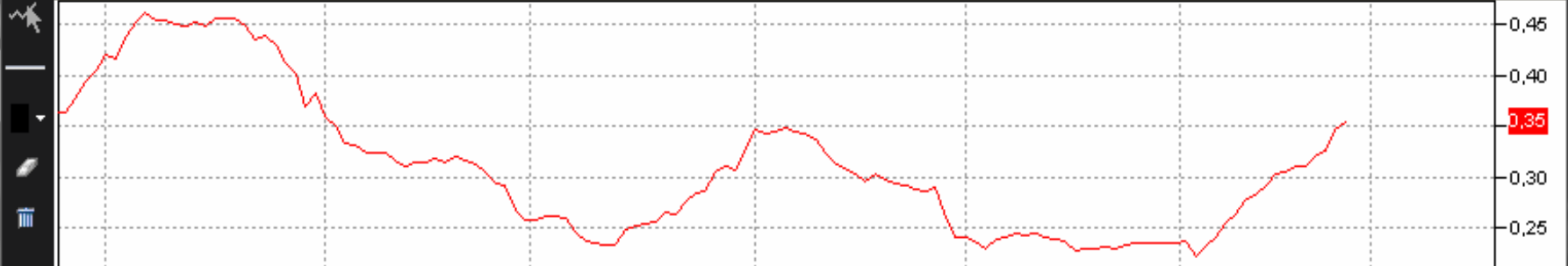


Dev. Std.: ENI



IWGT-FIAT INDUSTRIAL

1 day 6 mon... FI.MI



Stop di volatilità

Prezzo azione	8,41	Dev. Standard	0,27
ATR 20	0,35		

STOP ATR

LONG	
Prezzo azione	8,41
ATR	0,35
Factor ATR	2,5
Livello stop	7,535
Scostamento %	10,40%

Short	
Prezzo azione	8,41
ATR	0,35
Factor ATR	2,5
Livello stop	9,285
Scostamento %	10,40%

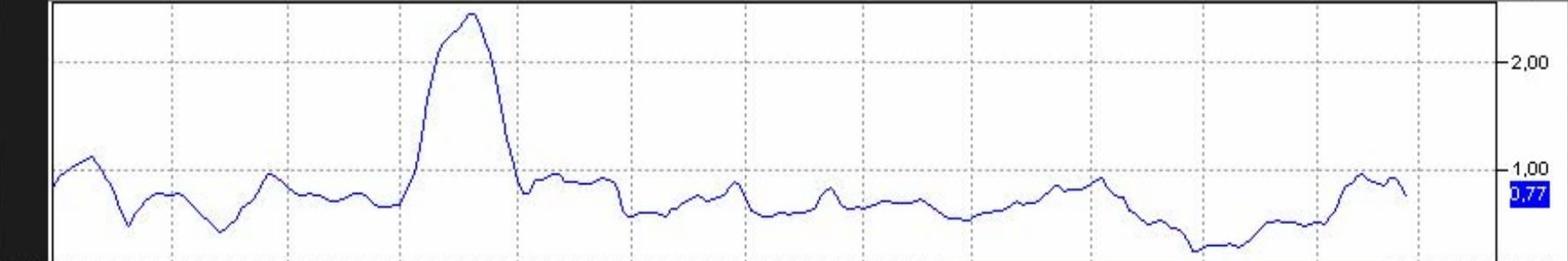
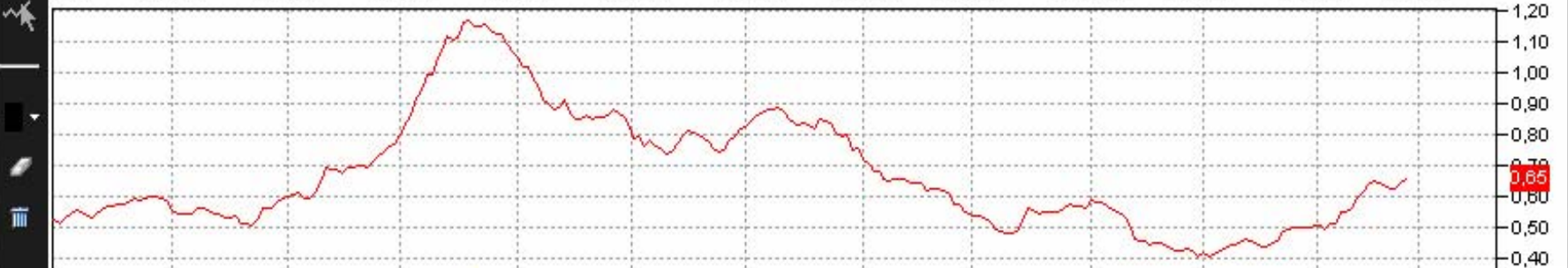
STOP DEV. STD.

LONG	
Prezzo azione	8,41
2 Dev. Std.	0,54
Livello stop	7,87
Scostamento %	6,42%

Short	
Prezzo azione	8,41
2 Dev. Std.	0,54
Livello stop	8,95
Scostamento %	6,42%

IWGT-EXOR

fw. [Icons] 1 day 6 mon.. [Icons] EXOR.MI



Stop di volatilità

Prezzo azione	17,35	Dev. Standard	0,76
ATR 20	0,65		

STOP ATR

LONG	
Prezzo azione	17,35
ATR	0,65
Factor ATR	2,5
Livello stop	15,725
Scostamento %	9,37%

Short	
Prezzo azione	17,35
ATR	0,65
Factor ATR	2,5
Livello stop	18,975
Scostamento %	9,37%

STOP DEV. STD.

LONG	
Prezzo azione	17,35
2 Dev. Std.	1,52
Livello stop	15,83
Scostamento %	8,76%

Short	
Prezzo azione	17,35
2 Dev. Std.	1,52
Livello stop	18,87
Scostamento %	8,76%

Strategia Twin Position

Capitale > 70.000 €

Max perdita

Capitale x 1%

es. $70.000€ \times 1\% = 700€$

Dimensione

Max perdita / distanza stop

es. $700€ / 10\% = 7.000€$

TWIN = $3.500€ \times 2$

Twin Trade management

Twin stop

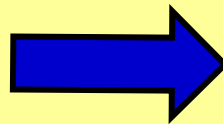
Twin 1 – 5% stop
Twin 2 – 10% stop
Stop effettivo 7,5%

Posizione

Posizione +8%
Twin 1 Vendita
Twin 2 Stop alla pari
poi Trailing stop

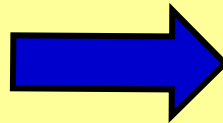
Calcolo del capitale

**Calcolo del
CAPITALE**



- + Liquidità portafoglio
- + Valore posizioni (*mark to market*)
- Calcolo perdite derivanti da:
 - Intervento degli Stop loss
 - Intervento dei Trailing stop

**Porzione non
investita**



Mantenere in liquidità
Investire in strumenti di liquidità

Mercati che tempo che fa

ITForum
2012

STAND
IWBANK



maurizio@mazzieroresearch.com

Tel. 334.1449694