

APPROFONDIMENTO SULL'ENTRATA E GESTIONE DELLA POSIZIONE CON LA STRATEGIA DIFENSIVA

www.PrevisioniBorsa.net

Considerando il fatto che noi puntiamo a controllare il rischio piuttosto che ad ottimizzare il rendimento ho ritenuto opportuno creare un'approfondimento legato al metodo di entrata e la gestione della posizione secondo il sistema che personalmente utilizziamo anche all'interno dell'area riservata di FS-Borsa.

Noi operiamo con il Future S&P/Mib ma e' chiaro che il concetto e' perfettamente identico per tutti gli altri strumenti finanziari (azioni comprese).

L'entrata ufficiale per migliorare il rapporto rischio/rendimento e' fatta dai minimi crescenti in caso di long o massimi decrescenti in caso di short, come spiegato nel manuale.

Vediamo subito un'esempio:



Una volta entrati vediamo di gestire la posizione per ridurre il rischio e possono succedere solo 3 cose:

1. I prezzi scendono e vanno velocemente sotto il minimo formato da tale incrocio dando un segnale di falsa inversione
2. I prezzi salgono ma non superano il massimo precedente (sempre formato dal solito incrocio di MM)
3. I prezzi salgono e superano il massimo precedente.

A questo punto non ci resta che difenderci da questi 3 punti e vediamo come:

Se i prezzi scendono velocemente sotto il minimo da cui noi abbiamo comprato si chiude l'operazione (stop-loss).



Le cause sono:

La tendenza non era quella preventivata ,il nostro conteggio ciclico non era corretto o e' stato solo un "Pacco" per catturare gli stop - loss.

Nel caso del punto 2 invece ci si difende chiudendo la posizione sempre con l'incrocio delle medie mobili se il massimo non supera il massimo precedente:



Supponiamo che l'entrata sia stata in quell'incrocio ma il massimo non supera e ne raggiunge quello precedente allora la posizione va chiusa al successivo incrocio contrario delle medie perché i prezzi hanno fatto sì un minimo superiore (primo indizio per l'inversione di tendenza o del ciclo) ma non hanno fatto un massimo superiore (conferma dell'inversione) quindi prima di aspettare che i prezzi vadano a catturare lo stop si esce limitando i danni o addirittura guadagnando qualcosa.

Nel terzo caso invece i prezzi superano il massimo precedente di conseguenza l'inversione è confermata, in tal caso si può alzare lo stop al livello dell'incrocio delle medie, vediamo un esempio:



In modo da ridurre ancora il rischio.

Il consiglio e' quello di puntare a spingerlo sempre verso il livello di incrocio.

In poche parole dopo l'entrata lo stop va sotto il minimo e appena i prezzi superano il massimo del ciclo precedente portarlo al livello dell'incrocio delle medie

Chiudere la posizione al successivo secondo incrocio contrario delle medie mobili:



n.b. Per cercare di tenere ampio il rendimento e' consigliato operare sempre in direzione dei cicli superiori (almeno il superiore).

Ovviamente tutti i concetti vanno invertiti in caso di short.

Riepilogando:

1. Contare e calcolare la posizione ciclica con gli indicatori DMMC e Velocita'
2. Entrare su incrocio delle medie mobili come spiegato nel manuale
3. Difendere e gestire la posizione come in questo approfondimento.

Auguro a tutti un buon trading online!

Se ci saranno altre novità o miglioramenti verranno redatti ulteriori approfondimenti.

Per sapere il nostro pensiero sulla posizione ciclica dell'indice S&P/MIB e future puoi visitare il sito www.previsioniborsa.net oppure se il tuo sogno è quello di diventare un Day Trader e quindi fare del trading online la tua principale attività puoi seguire il nostro servizio previsioni intraday!!

Buon trading,
Simone Fanton

www.previsioniborsa.net