

MB Double momentum stocks system

Quanto di seguito esposto risulta essere un trading system estremamente semplice e che in realtà dunque non è altro che un normalissimo metodo per fare trading sul mercato azionario, valido sia per le blue chips che per le small caps (in certi casi queste ultime, che spesso mostrano una maggiore volatilità e direzionalità, possono dare maggiori soddisfazioni). Preciso subito che i due strumenti utilizzati, graficamente simili in tutto e per tutto a due medie mobili, sono nati da studi personali legati allo sviluppo e alla ricerca del miglior timing di ingresso operativo sul mercato; essendo dunque strumenti di tipo proprietario preferisco non rendere pubblica la loro costruzione, non ora e non qui comunque. Vediamo passo per passo la semplice identificazione dei punti di ingresso e di uscita con il sistema.

Figura 1



Nella figura sopra sul grafico viene riportato il primo indicatore, lo strumento di base che segnala i set-up per l'entrata in posizione; come già detto è simile ad una media mobile anche se evidentemente la curva è certamente meno fluida, quindi anche il segnale che ne scaturisce è simile a quello che deriva dalla chiusura sopra/sotto una media mobile appunto. Si vede dunque (cerchi rossi) come il sistema generi segnali di acquisto, vendita e quindi ancora acquisto proprio in coincidenza con la chiusura sopra o sotto l'indicatore, seguita dal break di conferma il giorno successivo.

Figura 2



In questo grafico si può notare come il sistema, con l'utilizzo esclusivo dello strumento di base, soffra l'operatività nei momenti non direzionali, ed anche in questo caso mostra similitudini con la media mobile, anche se, per sua natura, una media con lo stesso parametro temporale avrebbe segnalato molti più incroci e decisamente un numero superiore di falsi segnali.

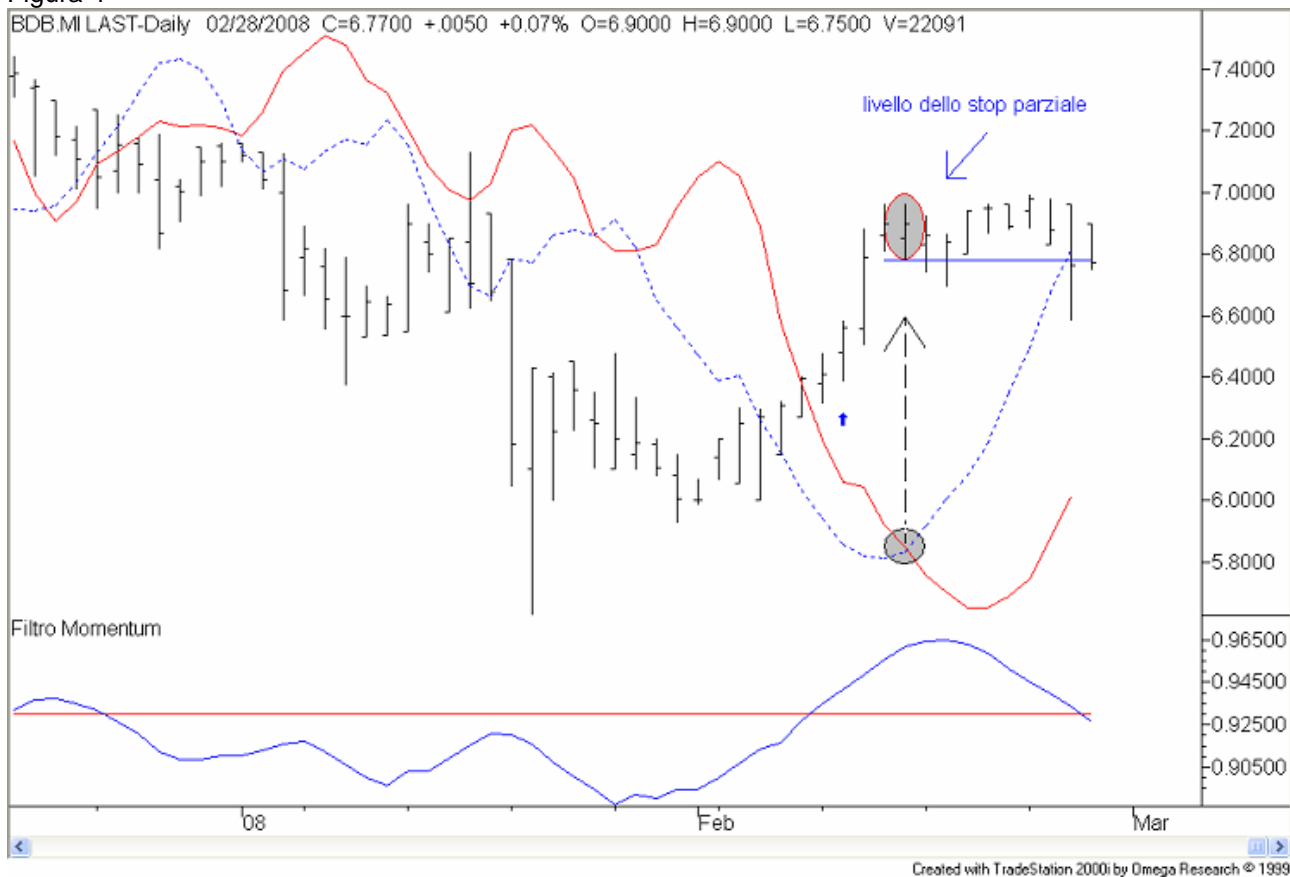
Figura 3



Sopra, il sistema viene implementato da un filtro appositamente costruito e che in alcuni casi permette di scartare alcune potenziali operazioni; la lettura è di estrema facilità: quando la linea blu è sopra la retta rossa che definisce il livello di divisione tra positività e negatività del momento, l'operatività sarà possibile al rialzo se, oltre all'incrocio dell'indicatore di base, il filtro sarà in positivo e viceversa per le operazioni negative.

Passo ora all'inserimento del secondo indicatore che affianca quello di base. In sostanza l'indicatore di supporto è molto simile al principale ma opera con un timing diverso, essendo il suo scopo principale quello di individuare i potenziali livelli di stop, profit parziale e profit finale, questi ultimi due entrambi realizzabili sotto forma di ordini in stop (quindi stop profit); praticamente si adotta la classica tecnica che mira a lasciar correre i profitti piuttosto che fissare obiettivi di prezzo fissi. Vediamo ora la combinazione degli indicatori.

Figura 4



Il secondo indicatore serve da controllo sulla posizione e stabilisce dunque i livelli di stop loss o stop profit sulle posizioni operative. Sopra è stato indicato l'incrocio tra il secondo indicatore e l'indicatore di base, situazione che determina il livello del primo stop e dunque su metà o comunque parte (soggettivo) della posizione: una conferma sotto il prezzo determinerà l'uscita immediata. Sul grafico si vede che dopo un'entrata a 6,47 avviene l'incrocio ed il prezzo che si determina di conseguenza stabilisce la base dello stop.

Figura 5



Lo stop definitivo viene invece identificato nel momento in cui i prezzi chiudono sopra (posizione short) o sotto (posizione long) al secondo indicatore; ciò significa che esiste la possibilità che il trend stia subendo una battuta di arresto a cui seguirà un periodo di prezzi in laterale oppure che stia addirittura tentando di invertirlo e quindi l'indicazione che ne deriva è la chiusura dell'operazione a titolo cautelativo.

Figura 6



Qui sopra notiamo quella che sembra una curiosità ma in realtà dimostra la bontà dell'indicatore di controllo: una volta verificatosi l'incrocio e stabilito il livello che determina lo stop parziale della posizione i prezzi realizzano un pullback sul livello, senza però chiudere sopra/sotto, quindi ripartono in direzione e continuano il movimento direzionale.

Figura 7



Un ultimo esempio di operatività sul titolo STM. Grazie all'uso combinato degli indicatori non solo si è operato con buoni risultati negli ultimi sei mesi ma anche soprattutto si sono ridotti notevolmente i rischi operativi.