

Qui sotto i primi tre grafici si riferiscono all'operatività con gli strumenti indicomi nella mail.



Situazione non particolarmente facile da gestire, in particolare per l'utilizzo delle medie mobili: il mercato manca di una reale e prolungata tendenza di fondo, pur non lavorando in trading range assoluto, quindi i segnali, pur non essendo eccessivamente numerosi, talvolta impediscono entrate efficaci. Comunque a parer mio devo dire che il metodo non è da sottovalutare perché in una fase ibrida non si comporta affatto male.



Questa è invece una delle situazioni più tragiche: movimenti poco significativi e repentini cambi di direzione impongono un'operatività frequente che, il più delle volte, si traduce in uno stop e reverse. Quando queste condizioni si dilungano nel tempo si rischia di trovare numerosi stop consecutivi non eccessivamente pesanti ma che, sommati tra loro, diventano gravosi, almeno nel brevissimo. In questo caso specifico la seconda parte della seduta ha permesso un paio di movimenti di cui uno interessante, motivo per cui il recupero delle perdite sarebbe stato agevole e veloce ma, in molti casi, questo non si verifica.



Qualche considerazione veloce. La strategia può essere interessante (come detto prima in risposta diretta alla tua mail) e andrebbe sottoposta ad un test per stressarlo (lungo e ben documentato soprattutto nelle fasi di trading range più insistente e persistente) ma, per quanto mi riguarda, male che vada credo possa essere utilizzata come studio di partenza per sviluppare una buona strategia da utilizzare nel lungo termine (evitando, come sempre, sovra ottimizzazioni inutili e deleterie).

Un appunto riguardo l'oscillatore Kase: al di là della sua affidabilità o meno nel riconoscere il potenziale trend del mercato, verificandolo nelle diverse condizioni operative mi dà la sensazione (ripeto, non ho avuto modo di effettuare un test prolungato) che in realtà non aggiunge granché alle medie mobili, essendo veramente pochissime le situazioni in cui ha inibito l'operatività generale e primaria, motivo per cui avrei qualche problema, sulla scorta di tali informazioni, a considerarlo un filtro efficace nella fattispecie (e con questo parametro, come da te indicato).

Ora, come mia abitudine, ti indico qualche differente approccio che potrai verificare da te e decidere se utilizzarlo in parte per implementare la tua tecnica; in caso contrario ti avrà dato modo di verificare condizioni operative diverse (sempre che tu non abbia già utilizzato tali strumenti assemblati tra loro per costruire una strategia).

Le differenze significative sono queste:

- utilizzo di due medie più "distanziate" a 9 e 50 periodi
- 
- la sostituzione del Kase indicator con il più conosciuto Price oscillator.

Qui sotto i due grafici con le varianti.



Situazione da "stress" estremo: il trading range, pur denotando una direzionalità di fondo ribassista, è agli estremi ed il bund si muove di pochi tick al rialzo ed al ribasso, pur realizzando massimi e minimi decrescenti per almeno la prima metà della seduta. Nonostante questo la strategia ripara da un numero eccessivo di operazioni e permette di non andare in perdita a causa del ristretto range operativo.



Questa seconda ipotesi prende invece ad esempio una seduta con una buona direzionalità, sia al rialzo che al ribasso. L'operatività ne guadagna e si nota come i due movimenti principali vengano presi con prezzi di entrata accettabili seppure non estremamente convenienti (non è l'obiettivo dei trend-following).

Quali sono le varianti, quindi?

La prima le due medie mobili: la prima a 9 mi serve per confermare l'entrata o dare la prima avisaglia, la seconda a 50 per stabilire il trend di fondo. Se i prezzi sono sotto si faranno solo operazioni al ribasso e viceversa.

La seconda è, come detto sopra, sull'oscillatore, utilizzato, piuttosto che sull'attraversamento della linea mediana, su rotture di trend-line disegnate sui valori dell'oscillatore stesso.

Combinando tutti gli elementi si può costruire la strategia indicata nei due ultimi grafici.