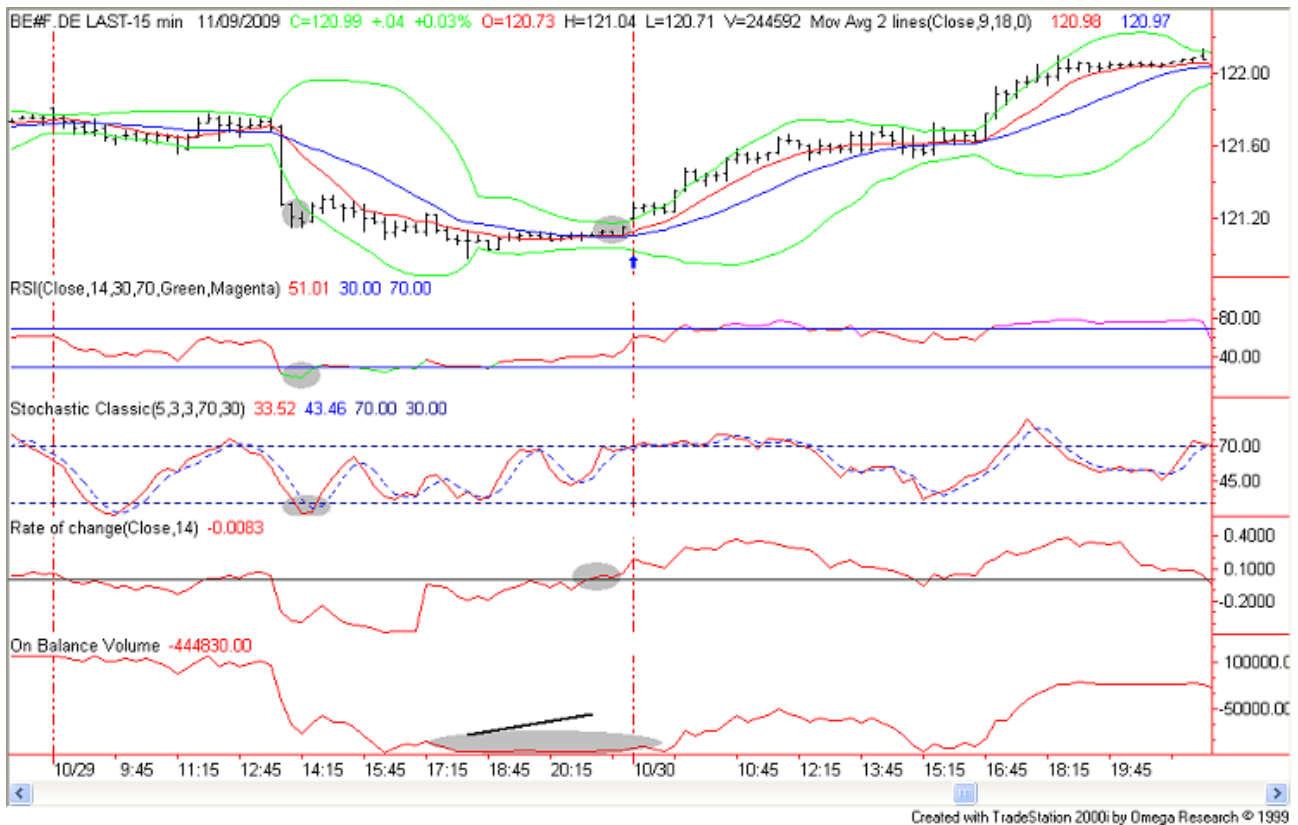


La prima questione da affrontare è l'opportunità o meno di utilizzare dunque un certo numero di indicatori e oscillatori. Come anticipato, se da una parte può evitare un discreto numero di possibili falsi segnali, dall'altra rischia di limitare eccessivamente l'operatività, condizione poco propizia per una strategia, sia essa intraday che su compressione giornaliera.

Qui sotto metto un grafico sul quale ho inserito diversi indicatori; la situazione che più balza all'occhio è che in due sedute viene permessa una sola operazione, in utile e interessante anche, ma solo ed esclusivamente questa.



E' evidente dunque come in tali casi ci si debba "accontentare" di un'operatività a bassa frequenza, situazione che potrebbe far comodo comunque a chi ha meno tempo da dedicare al trading o a chi non vuole farsi prendere dallo stress dello scalping.

Qui sotto invece li ho tolti quasi tutti, lasciando solo medie mobili e stocastico e il numero di operazioni diventa due, sempre poche ma il doppio di prima. La risposta operativa, infatti, arriva in anticipo dovendo osservare un numero inferiore di conferme dai numerosi oscillatori. E' quindi una via di mezzo, una sorta di compromesso utile a chiunque, non essendo comunque estremamente impegnativo ma permettendo, in ogni caso, una migliore operatività sul mercato (maggiori possibilità di trading).



In ultimo, lascio solo lo stocastico ed il numero di operazioni aumenta. Il che comprende anche due operazioni in perdita, ma se la strategia funziona i tempi di recupero della perdita dovrebbero essere relativamente veloci proprio in virtù del fatto che il numero di entrate è elevato.

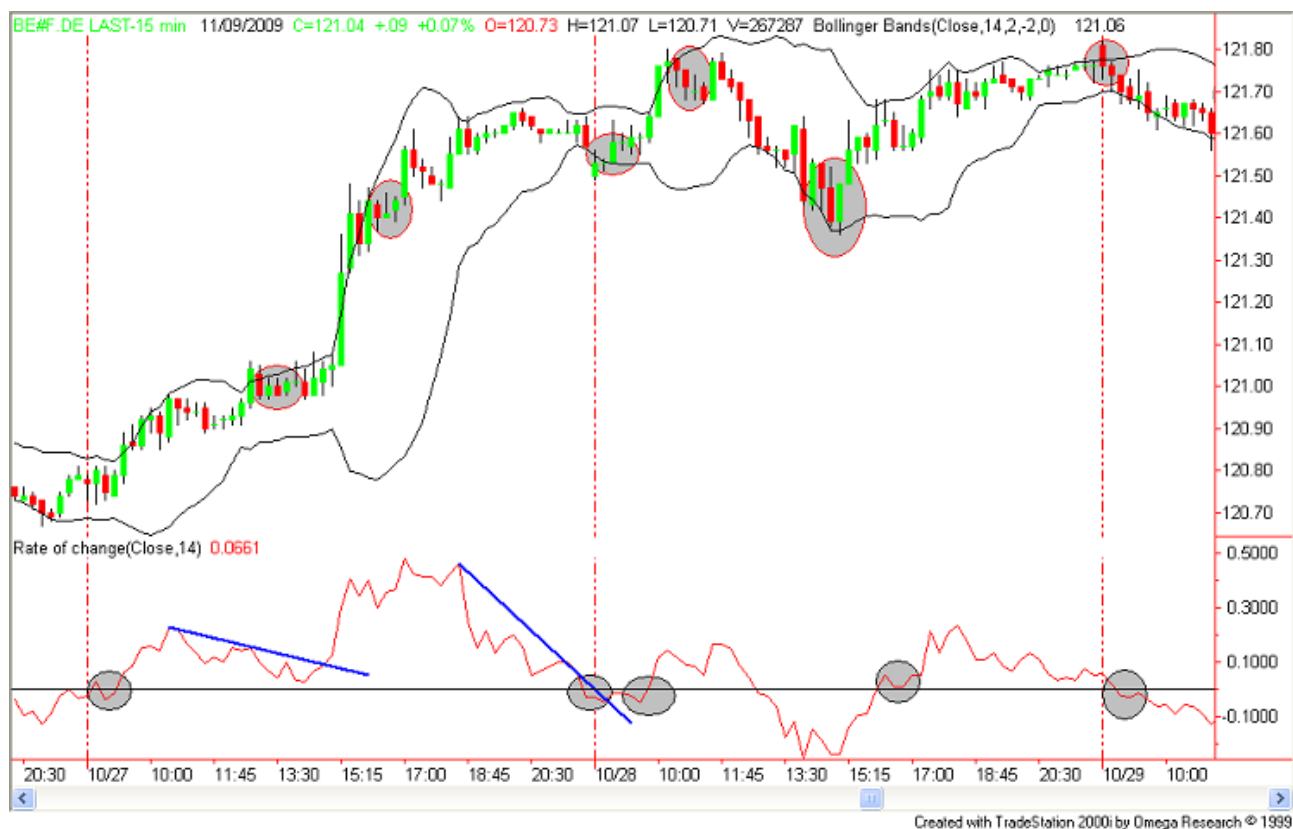


Ciò non vuole significare che usare più indicatori è sbagliato, semplicemente richiede una tipologia di trading più conservativa con i suoi pro ed i suoi contro; dovendo definirla in maniera banale direi che è più da speculatore-soft, poco adatta anche a chi volesse fare del trading la propria attività principale.

La seconda questione indicata nella mail è la più difficile: sapere esattamente come comportarsi sulle uscite una volta in posizione significa avere in mano la soluzione finale. Motivo per cui direi che do una mia interpretazione che, nel lungo termine, personalmente mi è tornata utile.

Prima cosa è l'utilizzo di regole precise: una volta stabilito che quel segnale genererà l'uscita o il livello di potenziale uscita per la mia posizione lo dovrò sempre osservare, altrimenti si rischia di osservare le regole quando non funzionano e trasgredirle quando avrebbero funzionato in pieno. E' chiaro che quanto espresso da ora in avanti riguarderà quelle situazioni in cui non si verifica preventivamente un segnale contrario in grado di generare uno stop ed un contestuale reverse della posizione stessa.

Un elemento da considerare, semplice e abbastanza utilizzato, potrebbero essere le Bande di Bollinger. Essendo strumento che misura la volatilità e la forza/debolezza di un mercato, l'adozione delle stesse come indicatore di uscita potrebbe anche tornare utile. Per esempio:



Un altro metodo possibile sarebbe legato ad una media mobile: la chiusura sopra/sotto la media genererebbe il segnale di uscita dallo short/long. Io preferirei utilizzare come segnale una doppia chiusura rispetto alla media, per maggiore sicurezza e per evitare i fin troppo numerosi falsi segnali su momentanei spike di prezzo e situazioni similari.



Altra possibilità deriva dall'attività di massimi e minimi consecutivamente inferiori o superiori; lo stop della posizione può essere validamente messo proprio sopra/sotto tali livelli, di un numero di tick variabile, per una eventuale maggiore sicurezza. In genere e su mercati più speculativi, quindi maggiormente soggetti a situazioni di alta volatilità, potrebbe essere opportuno alzarsi sul secondo massimo o abbassarsi sul secondo minimo, per evitare che movimenti repentini si portino marginalmente in break sul livello iniziale e poi rientrino immediatamente senza modificare il trend originario.

