

Utilizzo dello stocastico su grafici giornalieri

Il primo grafico indica un utilizzo di base dell'oscillatore; ad ogni incrocio rialzista corrisponde l'assunzione di una posizione long e, viceversa, ad ogni incrocio ribassista l'assunzione di una posizione short (in close di seduta o, in alternativa, in open del giorno successivo). Come si può vedere sotto, chiudendo la posizione in stoploss o eventualmente stop profit quando l'oscillatore inverte e si è in posizione, è possibile ottenere, nel periodo considerato, un ragionevole vantaggio delle operazioni in utile (6 contro 5) e un ancora più interessante rapporto tra guadagni e perdite (2,5:1 circa); visto così indubbiamente non ci sono dubbi e il metodo andrebbe utilizzato costantemente nell'intento di produrre utili anche nel medio e nel lungo periodo. Sotto vedremo delle varianti ed in particolare occorre precisare sin da subito che nella maggioranza dei casi l'utilizzo dello stocastico difficilmente permette di partecipare ai trend di medio e lungo periodo, preferendo di gran lunga la dinamicità che caratterizza i periodi di mercati "efficienti", periodi nei quali a ribassi di breve o brevissimo conseguono rialzi altrettanto di breve o brevissimo, indipendentemente dal trend di fondo di lungo periodo. A ciò si aggiunga che, proprio nei periodi di forte trend, spesso le segnalazioni dell'oscillatore si traducono in numerosi e continui falsi segnali, come evidenziato in fondo con l'ultimo grafico.



Il grafico sotto mostra la stessa situazione alla quale però vengono implementate alcune varianti: la prima richiede che non solo si verifichi l'incrocio al rialzo o al ribasso, ma anche che l'indicatore principale dell'oscillatore stocastico rientri in zona neutrale dopo l'ipercomprato o l'ipervenduto e solo in quel caso si può ritenere possibile considerare l'opportunità di entrare sul mercato; dico "si può considerare possibile" perché la definizione arriva solo quando la seconda variante trova soddisfazione, in questo caso, sui valori di mercato piuttosto che su quelli dell'oscillatore e praticamente richiede che la candela sia nella stessa direzione dell'incrocio (diciamo rossa in caso di incrocio rialzista e verde in caso contrario). Come si può vedere il rapporto tra operazioni migliora di netto, anche perché nel periodo considerato non si verifica alcuna operazione in perdita (da tenere presente che ciò non succede di frequente e le perdite fanno sempre parte della normale operatività); va da sé che anche il rapporto tra guadagni e perdite subisce un notevole miglioramento. I cerchi sul grafico in corrispondenza di alcune candele, infatti, fanno notare come alcuni segnali, potenzialmente validi sui valori dell'oscillatore, in realtà siano stati scartati a causa della mancanza di conferme sulle candele; potrebbero quindi essere ignorate, come indicato sotto o, eventualmente, relegate al ruolo di stop loss o stop profit alternativo allo stop finanziario, percentuale o dinamico (o altro).



Qui sotto un aggiustamento: l'introduzione della media mobile a 200 giorni, storicamente individuata dagli operatori del mercato come un ideale indicatore del trend di lungo periodo in atto, indica in quale direzione operare, eliminando dunque tutti gli short previsti e trasformandoli semplicemente in operazioni di chiusura dei long (chiaramente e unicamente validi nel periodo considerato, essendo i prezzi appunto sopra la media). Chiunque può vedere che non si notano miglioramenti particolari e, anzi, rispetto alle indicazioni sopra (secondo grafico) indubbiamente si ha un evidente calo della performance generale.



In questo nuovo grafico vengono invece indicate le opportunità in caso di divergenza tra i valori dell'oscillatore ed i prezzi di mercato; come si può notare si limita notevolmente l'operatività e, qualora si considerasse (come detto sopra) il vantaggio, o presunto tale, di operare solo in direzione del trend di lungo, addirittura le operazioni si ridurrebbero a una sola. (operatività dunque consigliata solo come complementare a quella principale e necessariamente più attiva).



Qui sotto un'idea alternativa: l'utilizzo della curva di regressione che in sostanza altro non fa che svolgere il ruolo di filtro come potrebbe fare una semplice media mobile di breve periodo (14 giorni in questo caso).



Infine questo ultimo grafico che deve assolutamente dare un'idea del fatto che lo stocastico, così come gli altri indicatori e/o oscillatori, non è in grado di garantire solo operazioni vincenti e, anzi, con particolare riferimento ai trend molto forti (in entrambe le direzioni) è foriero di molti falsi segnali; per questo occorre operare sempre sulla base di studi grafici a fronte di numerosi e lunghi backtest, nonché (eventualmente) il supporto di uno studio statistico. Qui sotto si vede bene come parecchi segnali abbiano generato numerose perdite per stoploss (qualora inserito, e sempre consigliabile), almeno fino a che il trend di fondo non ha subito un evidente cambiamento nella sua struttura; nel caso preciso sull'ultimo minimo è segnalata una evidente e importante divergenza.

