

Specifiche dei sistemi in abbonamento (in ordine come da tabella relativa)

TS Eagle SPMib future. Il sistema è un intraday puro e opera dunque dalle 9 alle 17,40, orario entro il quale qualsiasi operazione ancora aperta verrà obbligatoriamente chiusa. Lavora di base con un solo contratto e dunque eventuali variazioni al tema sono esclusivamente di carattere soggettivo; esegue generalmente un numero di operazioni non eccessivo (da 1 a 5) per seduta ed ha caratteristiche vicine a quelle dei sistemi trend-following, anche se diverge in parte dai tradizionali per un diverso utilizzo dello stop e trailing stop. Il trading system è adatto a chi può stare costantemente impegnato davanti al proprio pc (comunicazione segnali tramite ICQ) per seguire l'operatività completa: la natura dei trading system, in particolare quella dei trend-following e affini, è quella di performare molto bene in alcune situazioni e mostrare invece difficoltà in altre, motivo per cui l'utilizzo saltuario e solo per brevi periodi si rivela normalmente deleterio ed è caldamente sconsigliato dal sottoscritto. Chi non ha la possibilità di seguire assiduamente e almeno per un certo periodo di tempo il sistema (consigliato non meno di 6 mesi) è bene che utilizzi metodi discrezionali oppure si rivolga altrove. Non c'è alcuna garanzia che questi rendimenti possano ripetersi in futuro secondo le stesse modalità e risultati.

TS Eagle Dax future. Il sistema è un intraday puro e opera dunque dalle 8 alle 22, orario entro il quale qualsiasi operazione ancora aperta verrà obbligatoriamente chiusa. Lavora di base con un solo contratto e dunque eventuali variazioni al tema sono esclusivamente di carattere soggettivo; generalmente l'operatività termina, almeno per quanto riguarda l'apertura di nuove posizioni, entro le 18,30-19 (salvo rarissime occasioni) ed esegue generalmente un numero di operazioni non eccessivo (da 1 a 6-7) per seduta ed ha caratteristiche riconducibili a quelle dei sistemi trend-following. Il trading system è adatto a chi può stare costantemente impegnato davanti al proprio pc (comunicazione segnali tramite ICQ) per seguire l'operatività completa: la natura dei trading system, in particolare quella dei trend-following e affini, è quella di performare molto bene in alcune situazioni e mostrare invece difficoltà in altre, motivo per cui l'utilizzo saltuario e solo per brevi periodi si rivela normalmente poco o per nulla profittevole. Chi non ha la possibilità di seguire assiduamente e almeno per un certo periodo di tempo il sistema (consigliato non meno di 6 mesi) è bene che utilizzi metodi discrezionali oppure si rivolga altrove. Non c'è alcuna garanzia che questi rendimenti possano ripetersi in futuro secondo le stesse modalità e risultati.

TS DAX5. Lavora su timeframe basso e prende posizione, qualora ce ne fosse l'opportunità, tra le 8 del mattino e le 17,30 (salvo rarissime eccezioni); qualora, giunti alle 17,30 fosse ancora aperta la posizione, è possibile che la stessa venga mantenuta anche oltre questo orario con l'indicazione di uno stop, di un trailing stop e/o di un livello di profit. Ogni posizione è esclusivamente intraday, quindi non verrà mai portata oltre la chiusura. Il numero di operazioni può variare da 1 sola a 7-8 per seduta, generalmente 2-4 è la situazione più frequente (dipende dalla volatilità del mercato nel periodo considerato; essendo intraday può variare spesso e di molto). Il sistema è testato dalla fine di giugno 2009; il rendimento, espresso in punti, alla fine del mese di ottobre 2010 è pari a 5924 punti, pari a circa 370 punti mensili. Il DD sostenuto in questo lasso di tempo utilizzato per il test è stato pari a - 255 punti. Non c'è alcuna garanzia che questi rendimenti possano ripetersi in futuro secondo le stesse modalità e risultati.

TS MB Double-trend momentum. Il sistema è costruito per lavorare sul FIB intraday con compressione a 5 minuti; il funzionamento si basa sulle indicazioni fornite da due indicatori proprietari sulla base delle indicazioni di forza o debolezza accertate, escludendo le opportunità di vendita sulla forza e/o acquisto sulla debolezza offerte dalle situazioni classiche di ipercomprato o ipervenduto. Come variante non sistematica è l'utilizzo di un indicatore aggiuntivo (anche esso di momentum valido per l'intraday ma comunque non tipicamente da scalping, bensì valido per le situazioni di maggior respiro) che interviene laddove situazioni (potenzialmente) critiche mettono in affanno gli altri due ma solo ed esclusivamente in merito allo stoploss della posizione aperta in quel momento. Caratteristica principale: sistema di tipo trend-following intraday (quindi chiude inevitabilmente entro le 17,40), strutturato per tentare di entrare a prezzi più favorevoli rispetto ai sistemi tf tradizionali, per quanto possibile, che attendono spesso lunghi periodi prima di prendere posizione. Ciò permette una soluzione intermedia tra i metodi classici di tendenza ed i sistemi che operano

contro il trend in condizioni di ipercomprato e ipervenduto. Obiettivo principale: sfruttare movimenti anche ampi, per quanto possibile dato il timeframe ridotto, che, seppur non frequentemente, il mercato realizza intraday. Ciò crea i presupposti, tuttavia, per una percentuale rilevante di operazioni negative, a fronte però di maggiori possibilità di realizzare buoni utili nelle sedute molto direzionali. Indicazioni aggiuntive: lo stoploss (da inserire come stop cautelativo iniziale qualora non ne venga dato uno in concomitanza con il segnale di trading) non potrà mai essere superiore all'1,5% del valore del contratto (arrotondato al tick superiore se short e inferiore se long) al momento dell'entrata in posizione (es.: con un entrata a 19000 punti lo stop non potrà superare 2850 pti). Il profit potrà essere, indistintamente, un livello prefissato (aggiornabile in qualsiasi momento) oppure basato sul trailing stop classico. **Attenzione**: i risultati (del file allegato) nella colonna di destra sono relative alla prova in backtest; le performance valide a titolo ufficiale hanno come data di partenza il 10 gennaio 2011.

MBM60. Overnight che lavora su grafico del nostro FIB a 60 minuti. Il sistema basa la sua operatività principalmente su un indicatore di tipo proprietario che lavora sulla direzionalità multiday. I segnali vengono inviati durante la seduta e, nella maggior parte dei casi, la posizione rimane aperta anche overnight. Essendo di tipo trend-following beneficia di quei periodi in cui il mercato si muove con ampi movimenti e ritracciamenti veloci e poco incisivi; utilizza stoploss iniziali ampi, a causa della sua natura, motivo per cui ha un rischio operativo di entità medio-alta.

MB1. I sistemi sono operativi effettivamente sul mercato dall'inizio del 2006. I dati indicati alla pagina http://www.dimensionetrading.com/performance_dei_sistemi_di_tradi.htm (nella parte inferiore della pagina stessa) mostrano dunque i risultati limitatamente dal 2006 ad oggi; quindi chiunque volesse usufruirne tenga presente che i dati relativi alla perdita massima realizzata singolarmente e la perdita massima consecutiva potrebbero anche subire consistenti variazioni in futuro, in relazione, oltre che al funzionamento del sistema di trading, anche dei possibili cambiamenti che dovessero eventualmente intervenire sui mercati di riferimento, con particolare riguardo alla volatilità dei prezzi ed al valore della quotazione degli indici di riferimento. Quanto sopra è il riassunto delle prestazioni generali del sistema nel periodo considerato e nella loro interezza, quindi non si dispone di altre informazioni, più o meno dettagliate che siano, che non quelle pubblicate in questa pagina. **(l'operatività dei sistemi è sempre sospesa qualora l'open sia in gap, salvo diversa indicazione)**

Portafoglio di Gann. Il portafoglio di Gann è caratterizzato da una operatività tipicamente di breve termine, con durata delle operazioni tra 2 e 8 giorni circa, salvo eccezioni; l'operatività è riassunta in queste poche righe:

- gli ordini possono essere limite o in stop (più frequenti). Qualsiasi tipo di ordine in stop o a limite **non è da inserire se il titolo apre in gap**, salvo diversamente indicato nelle "note" della tabella ordini. Il portafoglio titoli si compone di non più di 5 titoli contemporaneamente, motivo per cui se vengono eseguiti uno o più ordini della giornata in corso che portano a superare il numero limite occorrerà provvedere a vendere le posizioni precedenti in portafoglio, partendo dalla più redditizia al momento e scalando fino a raggiungere di nuovo il livello massimo di nr. 5 titoli.

Ts P9 FIB. E' un sistema Intraday ad 1 operazione singola sul nostro derivato. Tra le 9 e le 9,05 vengono inviati i livelli di entrata per il long o lo short; lo stop ed il livello di profit vengono inviati al momento dell'entrata in posizione o, in casi particolari e rarissimi, qualora l'urgenza di comunicare il livello di entrata lo richieda, a distanza di pochi minuti dall'invio del segnale operativo, a prescindere dalla posizione a mercato o meno. Il sistema è stato testato per quasi due anni prima di essere commercializzato; i risultati sono visibili nella sezione all'estrema destra della tabella dei sistemi in abbonamento.