

TECNICHE INNOVATIVE DI TRADING E ANALISI DEI VOLUMI SUI MERCATI FINANZIARI

Milano, 14 novembre 2015

PROGRAMMA INDICATIVO

La ricerca dei livelli più importanti del mercato secondo l'analisi tradizionale:

- 1) analisi dei grafici a barre
- 2) miglioramento dei livelli con livelli nascosti usando il volume profile.
- 3) aggiunta di livelli come Fibonacci
- 4) le trend line dinamiche

Questa ricerca mira a determinare i livelli in cui nel passato il mercato ha invertito il suo trend o potrebbe farlo (per esempi i calcoli di Fibonacci).

Guardando i volumi dinamici (incontro tra domanda e offerta nel real-time) si possono derivare nuovi e più interessanti comportamenti, che diventano spesso ripetitivi.

A occhio nudo è impossibile percepire questi livelli, bisogna analizzare la price action con strumenti più sofisticati della semplice analisi visiva.

Grafico tick by tick : individuare i punti più importanti della sessione guardando le accelerazioni di volume.

Grafico a barre (5' 10' ecc) : i vari punti di flesso non sono necessariamente livelli importanti.

LA MICROSTRUTTURA DELLE ACCELERAZIONI DI VOLUMI

la domanda e offerta si scontrano nel realtime e generano volumi ==>

Come i volumi entrano sul mercato e il modo per decifrarli:

1. Dal confronto tra la partenza del movimento (primi secondi in cui entra l'ordine) e la sua prosecuzione, si ottengono dei pattern di comportamento molto chiari e sfruttabili nel breve termine.
3. un ordine importante può determinare un movimento di prezzo piccolo o ampio: la vischiosità dell'accelerazione. Significato di questa informazione, come sfruttarla.
2. classificazione dei pattern: pattern di reversal e pattern di continuation
3. come sfruttare operativamente questi segnali di breve nello scalping veloce (trade della durata di pochi secondi o pochi minuti).
4. usiamo questi livelli per filtrare i vari punti di flesso presenti sui chart a barre.

DALLA MICROSTRUTTURA DELLE ACCELERAZIONI ALLA VISIONE DELLA GIORNATA OPERATIVA

le principali accelerazioni della giornata, tra le 830 e le 1030, condizionano tutta la sessione

Spesso le accelerazioni si concentrano con ostinazione su livelli vicini questi livelli integrano bene i livelli dei Volume Profile

AGGREGHIAMO PIÙ GIORNATE INSIEME : LE ACCELERAZIONI CUMULATE

confronto con il market profile di più giorni

AGGREGHIAMO PIÙ GIORNATE DI PIÙ MERCATI , IN UNA VISIONE SINOTTICA E INTER MARKET : LE ACCELERAZIONI CUMULATE SINOTTICHE.

Osservare in un unico chart più mercati, trovando già indicato nel chart i livelli significativi di questi mercati.

Se su più mercati correlati (direttamente o in maniera inversa) si arriva contemporaneamente su livelli importanti, il segnale è robusto.

Come operare più facilmente nel pomeriggio, quando con i mercati USA aperti diventa difficilissimo tenere sotto controllo tutti i livelli (europei e americani).

Come utilizzare questi grafici quando bonds e equities si muovono in modo contrario, o quando gli indici seguono l'andamento di una valuta.

i timeframe utilizzabili : 2 giorni, 5 giorni, analisi di uno swing particolare (per esempio dal 24 agosto 2015).

BUYING E SELLING CLIMAX

L'importanza di sapere aspettare un momento di eccesso di mercato (euforia o panico).

Come riconoscere un momento di climax:

1) L'OVERSHOOTING

2) CLIMAX SUL BOOK (ECESSO DI FRETTA DEI COMPRATORI, O DEI VENDITORI)

3) CLIMAX DI VOLUMI

4) L'AMPIEZZA DEGLI SWINGS

Come sapere già a inizio giornata quali potrebbe essere il livello di climax sui volumi raggiunto il quale il mercato si ferma e torna indietro.

LE PRINCIPALI STRATEGIE

1. contrarian
2. continuation

CONTRARIAN

Individuati con precisione i livelli, se i prezzi arrivano a testare il livello in un climax si può entrare contrarian (long su mercati in discesa, short su mercati in salita)

Dove posizionare la stop

la differenza tra risk - reward e probabilità a proprio favore di un trade

CONTINUATION

Come si sviluppa una sessione di trend : come riconoscerla, e come lavorarla

Come individuare un movimento continuation di medio termine.

I VOLUMI IN APERTURA DI SESSIONE.

I VOLUMI IN CHIUSURA DI SESSIONE: GLI ORDINI MARKET ON CLOSE.

COME EVITARE I FALSI SEGNALI (ROTTURA RIALZISTA O RIBASSISTA SENZA PROSECUZIONE).

COME CAPIRE SE SI STA PREPARANDO LA ROTTURA DI UN TRADING RANGE

COME OPERARE CON QUESTI STRUMENTI AVANZATI SULLE BREAKING NEWS O SUI DATI MACRO.

Questo programma è solo indicativo

Nei prossimi giorni completerò la lista degli argomenti trattati.