

21-ago-2017

Chiusura Borse Asia/Pacifico (ore 09:00):

Giappone (Nikkei225)	-0,40%
Australia (Asx All Ordinaries)	-0,32%
Hong Kong (Hang Seng)	+0,46%
Cina (Shanghai)	+0,50%
Taiwan (Tsec)	+0,05%
India (Bse Sensex):	-0,23%

L'effetto generale per l'inizio della mattinata sui mercati Europei (tenendo conto dei pesi e delle correlazioni dei vari Indici Asiatici) è da considerarsi leggermente Negativo/Neutrale.

Come orari con Eventi (da me selezionati) che ritengo importanti per oggi:

Oggi non vi sono dati di rilievo per i Mercati Finanziari.

Vediamo ora i 4 future su Indici Azionari che seguono per valutare soprattutto il Ciclo

Settimanale - dati a 15 minuti a partire dal 4 agosto e aggiornati alle ore 09:05 di oggi 21 agosto- la retta verticale rappresenta l'inizio di tale ciclo:



Gli Indicatori Ciclici in figura (rappresentativi del Ciclo Settimanale) sono al ribasso per tutti i Mercati.

Analizziamo ora il **ciclo Settimanale** – è partito sui minimi dell'11 agosto intorno alle ore 10:30 ed è (in tempi idonei) nella sua fase di indebolimento. Potrebbe avere 1 gg (sino a 2) di ulteriore debolezza. Solo eventuali rimbalzi (a sorpresa) oltre certi livelli "critici" che definisco più sotto porterebbero ad un allungamento di questo ciclo.

Da segnalare una maggior debolezza per il miniS&P500 che h già rotto al ribasso i minimi iniziali il 17 agosto.

Prezzi "critici" da monitorare (tenendo conto dei fattori tempo, volumi e strutture cicliche e quindi possono variare di giorno in giorno):

- una ulteriore indebolimento può portare a:

- Eurostoxx: 3420-3388- 3350-3320
- Dax: 12075-11980-11900-11800
- Fib: 21540-21300-21150
- miniS&P500: 2420- 2410-2400- 2385

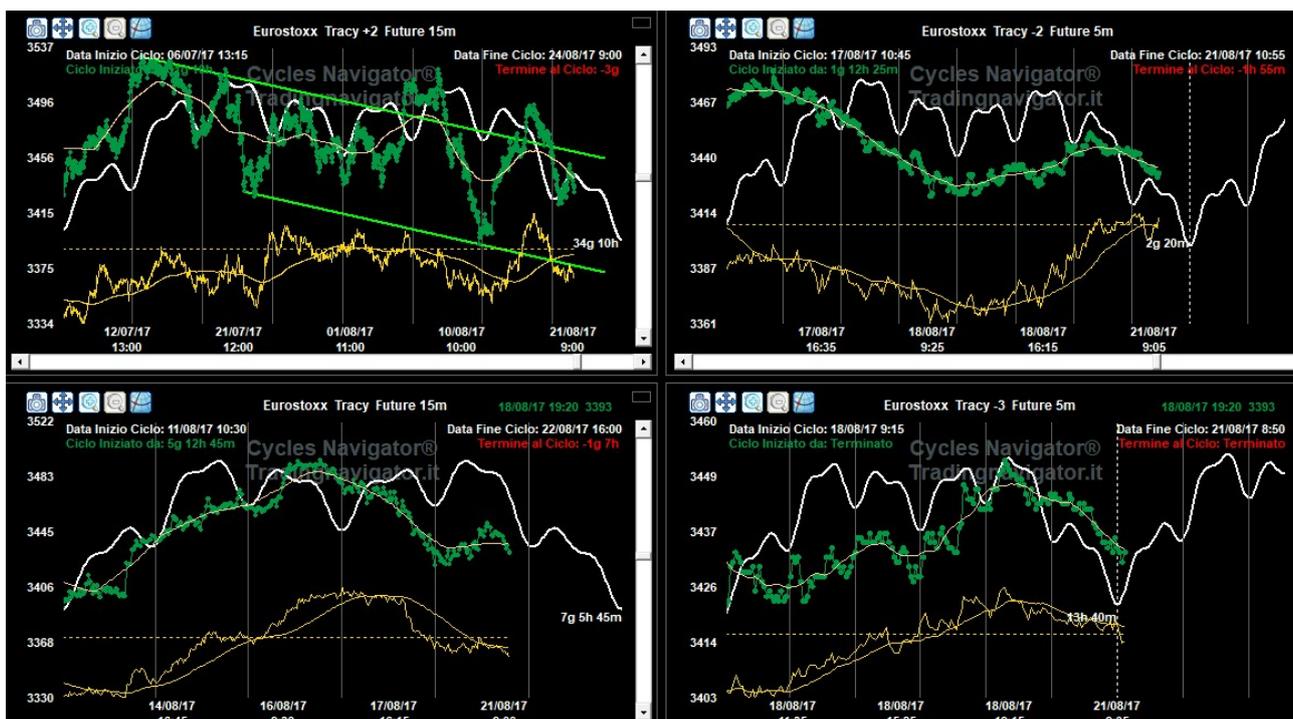
Valori sotto al 1° scritto sopra aumenterebbero la debolezza del Settimanale. Valori sotto a quello sottolineato confermerebbero debolezza sui cicli superiori

- dal lato opposto un po' di forza può portare a:

- Eurostoxx: 3453-3470- 3500
- Dax: 12200-12260-12300
- Fib: 21850- 22070
- miniS&P500: 2435-2445- 2455

Valori verso il 1° sottolineato annuirebbero la debolezza del Settimanale che potrebbe mutare forma- valori verso il 2° sottolineato ci direbbero di un nuovo Settimanale partito a sorpresa in anticipo e con effetti anche sui cicli superiori.

Vediamo ora la situazione Multi-Ciclica per l'Eurostoxx future e che vale anche per gli altri Indici Azionari (dati aggiornati alle ore 9:05 di oggi 21 agosto):



Valutiamo i Cicli secondo il metodo multi Ciclico. Questa valutazione parte dai Cicli più lunghi (trend principale) e poi osserva con la lente di ingrandimento cosa potrebbe accadere a livello intraday- le valutazioni delle forze in atto sui vari Cicli sono principalmente focalizzate sulla giornata odierna. Questa analisi (anche se fatta su un solo indice) vale anche per gli altri Indici Azionari a livello di tendenze principali. Eventuali differenze verranno evidenziate.

- in alto a sx c'è il metà-Trimestrale oppure Mensile (detto Tracy+2 -dati a 15 minuti)- è partito il 2° metà-Trimestrale sui minimi del 6 luglio. Vi è stato un movimento altalenante negli ultimi gg con rialzi “fuori scala”. Mancherebbe una ulteriore fase di indebolimento per andare alla chiusura del ciclo intorno al 25 agosto, ma potrebbero esservi delle variazioni nelle tempistiche.

- in basso a sx c'è il Ciclo Settimanale (o Tracy -dati a 15 minuti)- ciclo partito l'11 agosto mattina- più sopra ho descritto le sue potenzialità e non mi ripeto.

- in alto a dx c'è il Ciclo bi-Giornaliero (o Tracy-2 -dati a 5 minuti- è un ciclo meno importante)- è un ciclo attualmente poco affidabile, con ripetute false partenze- pertanto non lo commento.

- in basso a dx c'è il Ciclo Giornaliero (o Tracy-3 -dati a 5 minuti)- è partito il 18 agosto intorno alle ore 09:15 Potrebbe trovare un minimo conclusivo entro le ore 10:30 A seguire un nuovo Giornaliero che è atteso debole.

Vediamo le strategie intraday che Io utilizzo in base alle conformazioni cicliche potenziali attuali:

<u>Trade Rialzo</u>	<u>Acquisto sopra</u>	<u>Take-Profit (punti)</u>	<u>Stop-Loss sotto</u>
Eurostoxx-1	3453	8-9	3446
Eurostoxx-2	3470	9-10	3462
Dax-1	12175	16-17	12160
Dax-2	12200	21-22	12180
Fib-1	21850	45-50	21810
Fib-2	21940	45-50	21900
miniS&P500-1	2435	2,75-3	2432,5
miniS&P500-2	2441	2,75-3	2438,5

<u>Trade Ribasso</u>	<u>Vendita sotto</u>	<u>Take-Profit (punti)</u>	<u>Stop-Loss sopra</u>
Eurostoxx-1	3420	11-12	3430
Eurostoxx-2	3400	8-9	3407
Eurostoxx-3	3388	11-13	3398
Dax-1	12075	16-17	12090
Dax-2	12040	21-22	12060
Dax-3	11980	21-22	12000
Fib-0	21740	45-50	21780
Fib-1	21650	55-60	21700
Fib-2	21540	55-65	21590
miniS&P500-1	2420	3,25-3,5	2423
miniS&P500-2	2410	3,25-3,5	2413

Avvertenza.: leggere attentamente le Regole di Trading che Io utilizzo

Ricordo che per valutare un metodo di Trading bisogna vedere tutti i segnali ogni giorno, e non solo saltuariamente o quando ciascheduno lo ritenga opportuno.

Vediamo anche il grafico per Euro/Dollaro e Bund - dati a 15 minuti a partire dal 4 agosto ed aggiornati alle ore 09:05 di oggi 21 agosto- la retta verticale rappresenta l'inizio del ciclo Settimanale:



Euro/Dollaro

- Ciclo Settimanale – sembra partita una nuova fase sui minimi del 17 agosto intorno alle ore 13:40. Potrebbe avere 2 gg di leggera spinta, ma la forza dipende anche dagli scenari sul ciclo superiore che come abbiamo visto nel report di ieri sono 2.

- Ciclo Giornaliero – sembra partito venerdì intorno alle ore 10:10 e non ha particolare forza. Potrebbe trovare un minimo conclusivo entro le ore 11:30. A seguire un nuovo Giornaliero atteso a leggera prevalenza rialzista.

A livello di Prezzi “critici” da monitorare:

- un po’ di ripresa (legata al nuovo Settimanale) può portare a 1,1765-1,1790 – oltre c’è 1,1825
 - dal lato opposto ci può stare una correzione sino a 1,171- valori sotto 1,169 ci direbbero di un ciclo senza forza e che potrebbe entrare in debolezza anticipata.

Come livelli di Trading Intraday che io utilizzo in base a quanto vedo ora abbiamo:

<u>Eur/Usd</u>	<u>Acquisto sopra</u>	<u>Take-Profit (punti)</u>	<u>Stop-Loss sotto</u>
<u>Trade Rialzo-1</u>	1,1770	0,0014-0,0015	1,1757
<u>Trade Rialzo-2</u>	1,1790	0,0016-0,0017	1,1775
	<u>Vendita sotto</u>	<u>Take-Profit</u>	<u>Stop-Loss sopra</u>
<u>Trade Ribasso-1</u>	1,1710	0,0013-0,0014	1,1722
<u>Trade Ribasso-2</u>	1,1690	0,0014-0,0015	1,1703

Bund

- Ciclo Settimanale – è partito sui minimi del 16 agosto intorno alle ore 11:45 ed ha una buona forza. Potrebbe avere 1 gg (sino a 2) di leggera prevalenza rialzista e poi 2 gg di debolezza per andare a chiudere.

- Ciclo Giornaliero – situazione poco chiara- diciamo che la mattinata potrebbe non avere forza con un minimo conclusivo entro le ore 12. A seguire un nuovo Giornaliero atteso a leggera prevalenza rialzista.

A livello di Prezzi “critici” da monitorare:

- una ulteriore forza può portare a 164,5 e sino ai massimi di 164,65- oltre c'è 164,8 e 165
- dal lato opposto possono esservi discese verso 164 e 163,7- valori sotto 163,5 metterebbero in indebolimento anticipato il Settimanale.

Come livelli di Trading Intraday che Io utilizzo in base a quanto vedo ora abbiamo:

<u>Bund</u>	<u>Acquisto sopra</u>	<u>Take-Profit (punti)</u>	<u>Stop-Loss sotto</u>
<u>Trade Rialzo-1</u>	164,30	0,09-0,10	164,22
<u>Trade Rialzo-2</u>	164,50	0,09-0,10	164,42
	<u>Vendita sotto</u>	<u>Take-Profit</u>	<u>Stop-Loss sopra</u>
<u>Trade Ribasso-1</u>	164,00	0,08-0,09	164,07
<u>Trade Ribasso-2</u>	163,85	0,08-0,09	163,92

Operatività in OPZIONI, Etf, Spread su vari mercati (operatività che personalmente sto seguendo)

Nulla da aggiungere a quanto scritto nei report del fine settimana.

Per il Trading ricordo le 10 regole generali che adotto per la Mia operatività:

- 1- I Prezzi di Ingresso sono la parte più importante della tabella – questi (e gli Stop-Loss) sono più corretti alla rottura dei prezzi scritti sopra e non sui prezzi scritti sopra – per rottura si intende 1 o 2 tick sopra (acquisto) o sotto (vendita)
- 2- I Prezzi di ingresso restano Validi per la giornata fino a quando non viene toccato lo Stop-Loss- dopo le ore 19 meglio non operare su Eurostoxx-Dax-Bund a meno che non si abbiano posizione aperte in precedenza e che **comunque vanno chiuse a fine giornata**
- 3- Se si verificano per es. prima i Segnali Rialzisti, quelli Ribassisti restano validi (per la giornata) a meno che si sia arrivati al Take-Profit del segnale Rialzista- la stessa cosa vale se si verificano prima i segnali Ribassisti
- 4- Come gestione della Posizione, quando scrivo Take-Profit 10-15 (es. Eurostoxx) significa che arrivati ad un utile di 10 punti o si esce dal Trade o perlomeno si alza lo stop a pareggio (ovvero a livello di ingresso)- al raggiungimento di un utile di 15 punti o si esce (ma chi ha delle sue regole di profit dinamiche, e quindi basate sul movimento dei prezzi, può rimanere ancora nel trade) o comunque si mette uno stop profit a 10 punti
- 5- Le rotture di livelli di Prezzi di Ingresso sui vari mercati in tempi vicini si auto confermano
- 6- Talvolta su alcuni trade non c'è proporzione tra Take-Profit e Stop-Loss, ma se li metto significa che sono gli unici stop-loss statici che mi sento di dare in base a quanto vedo in quel momento su base ciclica- se si considerano troppo elevati gli Stop-Loss non si opera, oppure si usano Stop-Loss proporzionali ai Take-Profit (ma si rischia di più in termini di probabilità che lo stop-loss venga preso)
- 7- I migliori Stop-Loss e soprattutto Take Profit sono dinamici e non statici
- 8- Bisogna anche tenere conto di potenziali false rotture negli orari di uscita di dati sensibili (segnalati sempre all'inizio del Report)
- 9- Per diminuire il rischio sarebbe meglio operare almeno su 2 dei precedenti mercati più 1 tra Euro/Dollaro e Bund
- 10- Talvolta, malgrado la visione della giornata si più rialzista (o ribassista), metto più livelli di trading nella direzione opposta- ciò non è un controsenso, ma spesso sono livelli che se superati negherebbero la lettura ciclica prevalentemente rialzista (o ribassista) preventivata. Inoltre, soprattutto su forti movimenti direzionali, sono più chiari i livelli di prezzo nella direzione opposta.

Aggiungo che per valutare i risultati dei miei segnali non ha senso vederli solo per qualche giorno, ma come qualsiasi tecnica di trading va valutata con continuità su una serie di segnali forniti e sui vari mercati. Chiaramente ci sono dei momenti di perdita (quando i cicli sono meno chiari), ma spesso le giornate si chiuderebbero in pareggio (o quasi) seguendo i segnali rialzisti e poi quelli ribassisti (o viceversa) sullo stesso mercato. Quando vi è poi una sequenza di operazioni positive si punta a recuperare e a guadagnare.

Per quanto riguarda l'Operatività in Opzioni che scrivo (che è parte di quella che effettivamente faccio), i prezzi dell'esecuzione (rispetto ai miei) possono differire di molto in funzione di: valore del sottostante, volatilità, tempo alla scadenza. Ciò porta inevitabilmente ad una struttura di rendimento/rischio differente. Anche le uscite dai Trade in Opzioni a volte devono essere tempestivi e se non si riesce a essere rapidi (perché non si segue sempre il mercato) si perdono opportunità di buone uscite in profit (ma anche in stop-loss).