

17-ago-2017

Borse Asia/Pacifico (ore 09:00):

Giappone (Nikkei225)	-0,06%
Australia (Asx All Ordinaries)	-0,14%
Hong Kong (Hang Seng)	-0,26%
Cina (Shangai)	+0,51%
Taiwan (Tsec)	+0,77%
India (Bse Sensex):	+0,03%

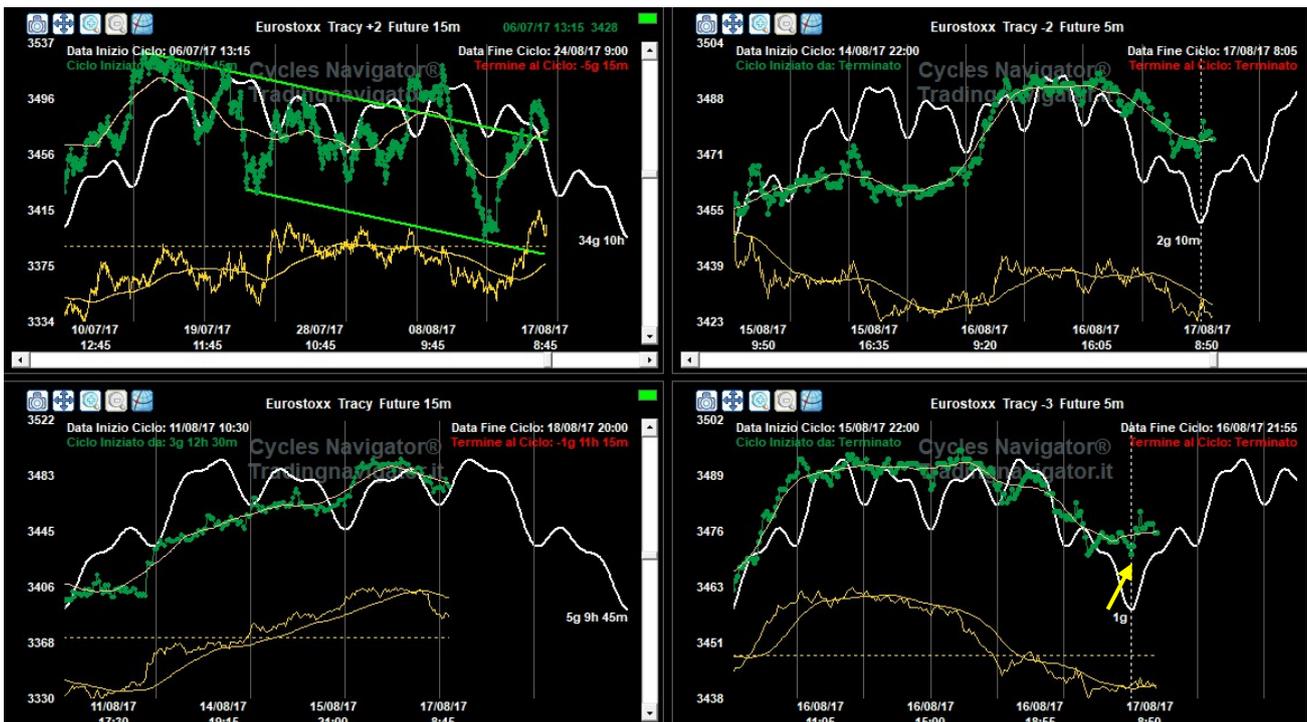
L'effetto generale per l'inizio della mattinata sui mercati Europei (tenendo conto dei pesi e delle correlazioni dei vari Indici Asiatici) è da considerarsi Neutrale.

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

Come dati sensibili per i Mercati Finanziari abbiamo:

- Inflazione Eurozona (ore 11:00)
- Richiesta Sussidi Disoccupazione Usa (ore 14:30).
- Produzione Industriale Usa (ore 15:15).

Vediamo ora la situazione Multi-Ciclica per l'Eurostoxx future e che vale anche per gli altri Indici Azionari - dati aggiornati successivamente alle ore 09:05 di oggi 17 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. Malgrado il rialzo degli ultimi gg mancherebbe una fase di graduale indebolimento per andare alla chiusura del ciclo intorno al 25 agosto. Le decise oscillazioni (sui vari mercati) a partire dai minimi del 3 agosto, potrebbero modificare la struttura di questo ciclo.

- in basso a sx c'è il Ciclo Settimanale (o Tracy -dati a 15 minuti)- ciclo partito l'11 agosto mattina ed ha una buona forza. Per andare a chiudere mancherebbero 2 gg di leggero indebolimento, ma si potrebbe anche avere una fase laterale di 1 gg e poi 2 gg di leggero indebolimenti.

- 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, cosa che accade quando vi sono delle incongruenze sui cicli superiori, che sono legate a degli sfasamenti (cicli che partono in momenti differenti).

- in basso a dx c'è il Ciclo Giornaliero (o Tracy-3 -dati a 5 minuti)- è partito il 15 agosto in apertura. Potrebbe trovare un minimo conclusivo a breve. Il successivo Giornaliero è atteso senza particolare forza.

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

- una ulteriore ripresa di forza può portare a:

- Eurostoxx: 3500-~~3525~~- 3550

- Dax: 12300- ~~12330~~- 12400

- Fib: ~~22070~~-22200-22400

- miniS&P500 (situazione leggermente differente): ~~2475~~- 2482-~~2490~~

Valori oltre il 1° scritto sopra ci direbbero di un Settimanale in ulteriore ripresa di forza e che probabilmente si allungerebbe. Valori oltre il 2° sottolineato riporterebbero forza sui cicli superiori (già evidente su Fib ed S&P500) i quali potrebbero mutare forma.

- dal lato opposto una ripresa dell'indebolimento può portare a:

- Eurostoxx: 3445-~~3420~~-3388

- Dax: 12180-12100- ~~12050~~-11980

- Fib: 21760-21650-~~21450~~-21300

- miniS&P500 (situazione leggermente differente): 2460-2450- ~~2440~~- ~~2430~~

Valori verso il 1° sottolineato metterebbero in debolezza il Settimanale. Valori sotto il 2° sottolineato confermerebbero debolezza sui cicli superiori.

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	3500	9-10	3492
Eurostoxx-2	3525	911-12	3515
Dax-1	12300	16-17	12285
Dax-2	12330	21-22	12310
Fib-1	22070	45-50	22030
Fib-2	22200	55-60	22150
miniS&P500-1	2475	2,75-3	2472,5
miniS&P500-2	2481	2,75-3	2478,5

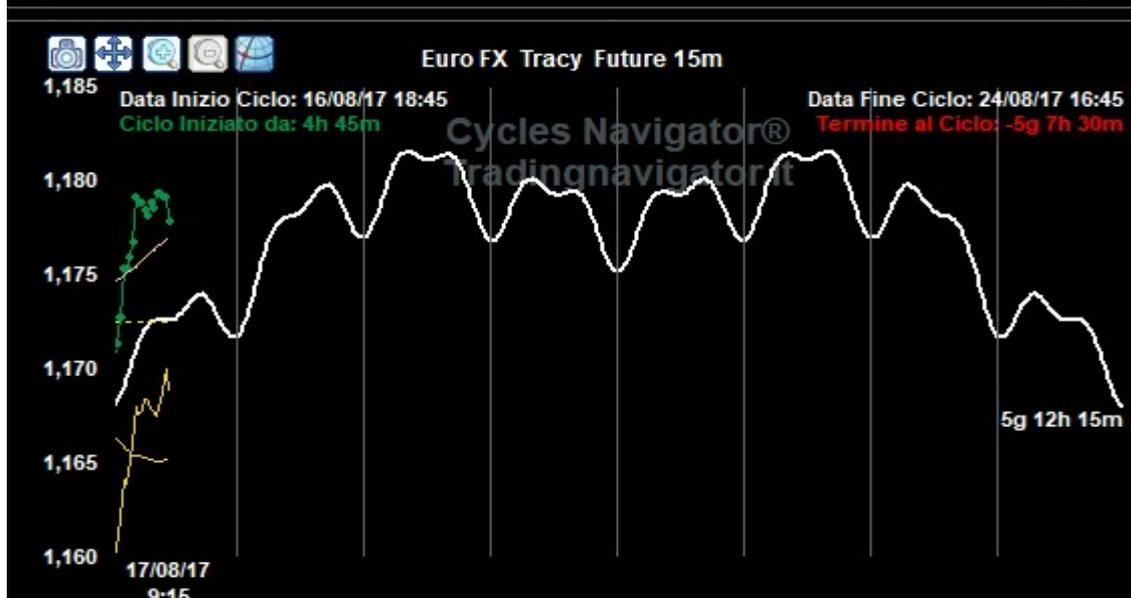
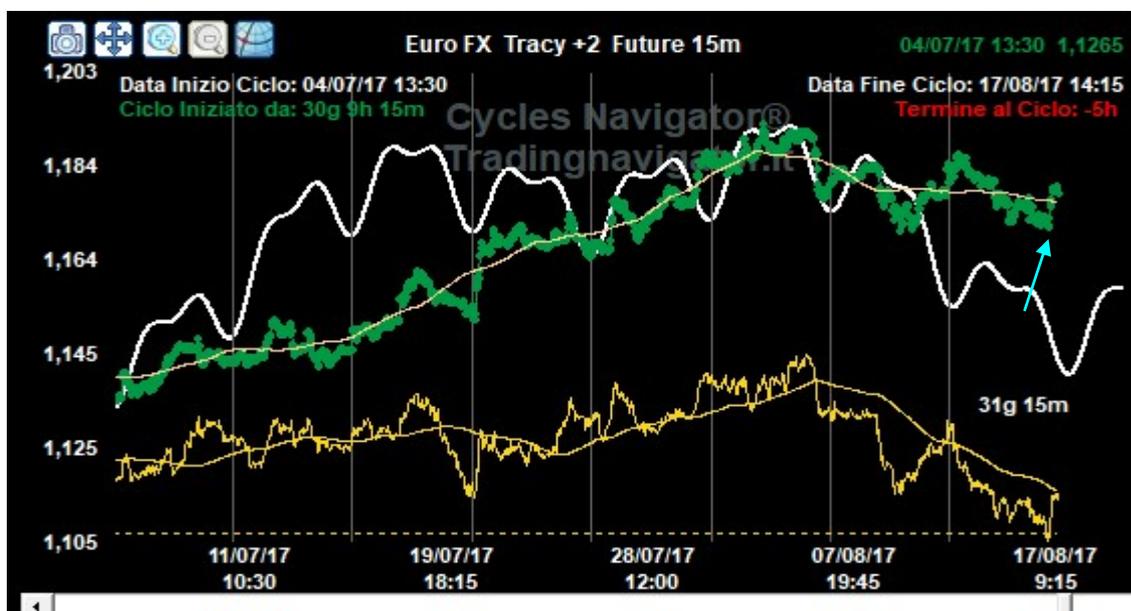
<u>Trade Ribasso</u>	<u>Vendita sotto</u>	<u>Take-Profit (punti)</u>	<u>Stop-Loss sopra</u>
Eurostoxx-1	3460	8-9	3467
Eurostoxx-2	3445	9-10	3453

Dax-1	12210	16-17	12225
Dax-2	12185	16-17	12200
Dax-3	12150	21-22	12170
Fib-1	21870	45-50	21910
Fib-2	21760	55-60	21810
miniS&P500-1	2460	3,25-3,5	2463
miniS&P500-2	2454	2,75-3	2456,5

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 ora la situazione Multi-Ciclica per l'Euro/Dollaro (dati aggiornati alle ore 09:05 di oggi 17 agosto):



- in alto a sx c'è il metà-Trimestrale o Mensile (o Tracy+2 -dati a 15 minuti)- è partito sui minimi del 4 luglio ed ha avuta una costante forza. Potrebbe essere terminato sui minimi di del 16 agosto pomeriggio, ma attendiamo conferme. Se così fosse potremmo avere una ripresa di forza sino ad inizio settembre.

- in basso a sx c'è il Ciclo Settimanale (o Tracy -dati a 15 minuti) – sembra partita una nuova fase sui minimi del 16 agosto intorno alle ore 15:45 e per ora ha una leggera forza. Potrebbe proseguire con 3 gg a prevalenza rialzista. Chiaramente discese a sorpresa sotto i minimi di ieri porterebbero ad un allungamento del ciclo precedente.

A livello di Prezzi “critici” da monitorare:

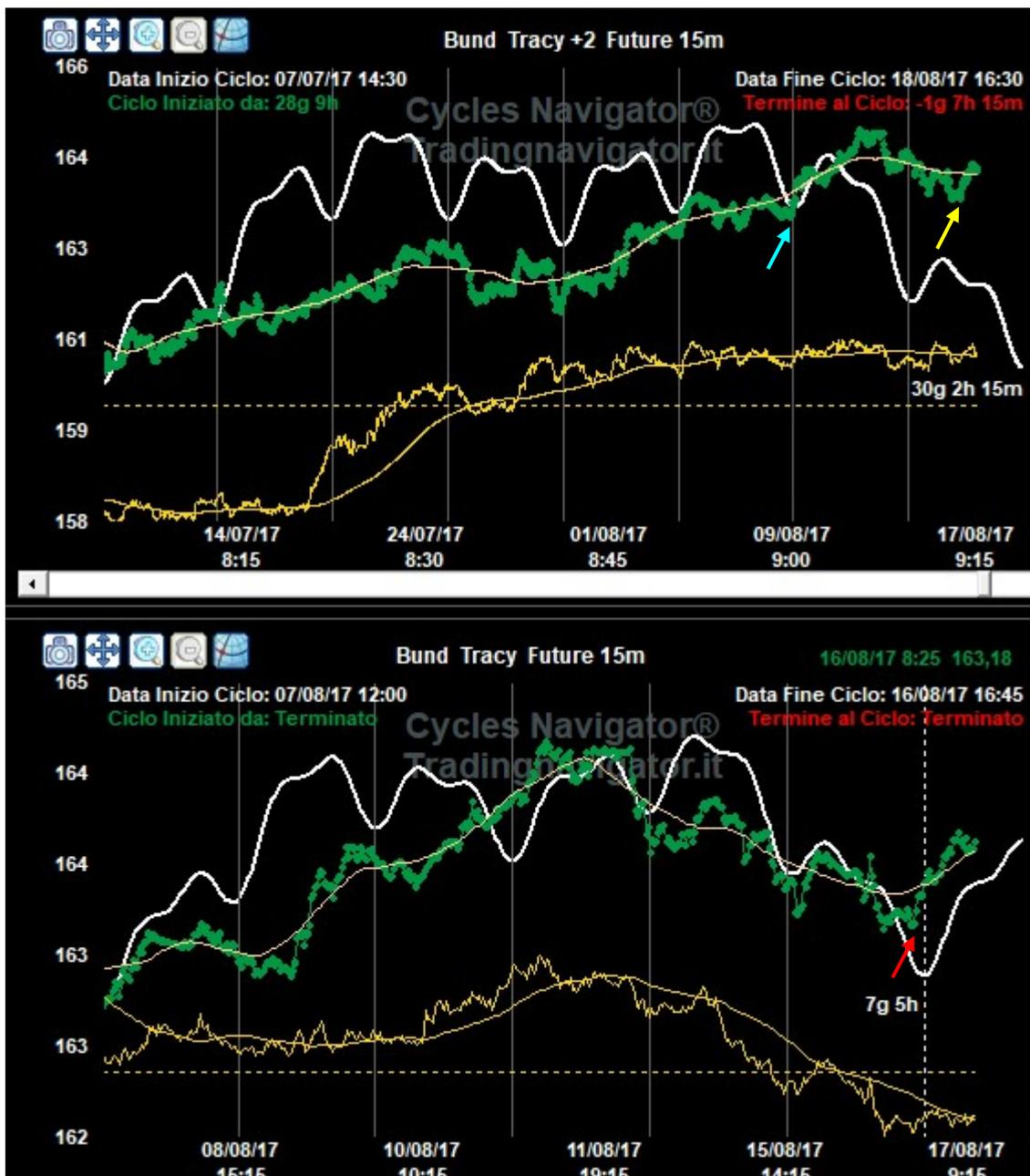
- un po' di ripresa può portare oltre 1,1790 e 1,1825 che confermerebbero un nuovo Settimanale

- dal lato opposto ci può stare una correzione sino a 1,1725, ma discese sotto 1,170 e verso 1,168 ci direbbero di una fase più legata al precedente Settimanale.

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>	1,1790	0,0014-0,0015	1,1777
<u>Trade Rialzo-2</u>	1,1820	0,0016-0,0017	1,1805
	<u>Vendita sotto</u>	<u>Take-Profit</u>	<u>Stop-Loss sopra</u>
<u>Trade Ribasso-1</u>	1,1725	0,0013-0,0014	1,1737
<u>Trade Ribasso-2</u>	1,1700	0,0014-0,0015	1,1713

Vediamo ora la situazione Multi-Ciclica per il Bund future (dati aggiornati alle ore 09:05 di oggi 17 agosto):



- in alto a sx c'è il metà-Trimestrale o Mensile (o Tracy+2 -dati a 15 minuti) – è partito sui minimi del 7 luglio e restiamo su 2 possibilità:

1- è un Mensile che si è concluso il 7 agosto (vedi freccia ciano)- in tal caso potremmo avere una ripresa rialzista sino a circa il 25 agosto

2- è un ciclo più lungo (come in figura) che potrebbe essersi concluso il 16 agosto (vedi freccia gialla) oppure che potrebbe avere ancora una leggera debolezza (non è chiaro).

- Ciclo Settimanale (o Tracy -dati a 15 minuti) – sembra partita una nuova fase in tempi idonei sui minimi del 16 agosto intorno alle ore 11:40 ed ha una leggera forza. Potrebbe avere 2-3 gg di leggera prevalenza rialzista, ma molto dipende da quale ipotesi prevarrà sul ciclo superiore.

A livello di Prezzi "critici" da monitorare:

- una ripresa di forza portare a 164,25-164,5 e poi oltre 164,65

- dal lato opposto possono esservi discese verso 163,7- valori sotto 163,5 e verso 163,35 cambierebbero la forma del Settimanale- oltre c'è 163.

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

Bund	Acquisto sopra	Take-Profit (punti)	Stop-Loss sotto
Trade Rialzo-1	164,00	0,09-0,10	163,92
Trade Rialzo-2	164,25	0,09-0,10	164,17
	Vendita sotto	Take-Profit	Stop-Loss sopra
Trade Ribasso-1	163,70	0,08-0,09	163,77
Trade Ribasso-2	163,50	0,08-0,09	163,57

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

Nulla da aggiungere al precedente report.

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 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).