

24-ago-2017

Borse Asia/Pacifico (ore 09:00):

Giappone (Nikkei225)	-0,42%
Australia (Asx All Ordinaries)	+0,16%
Hong Kong (Hang Seng)	+0,45%
Cina (Shangai)	+0,49%
Taiwan (Tsec)	+0,79%
India (Bse Sensex):	+0,02%

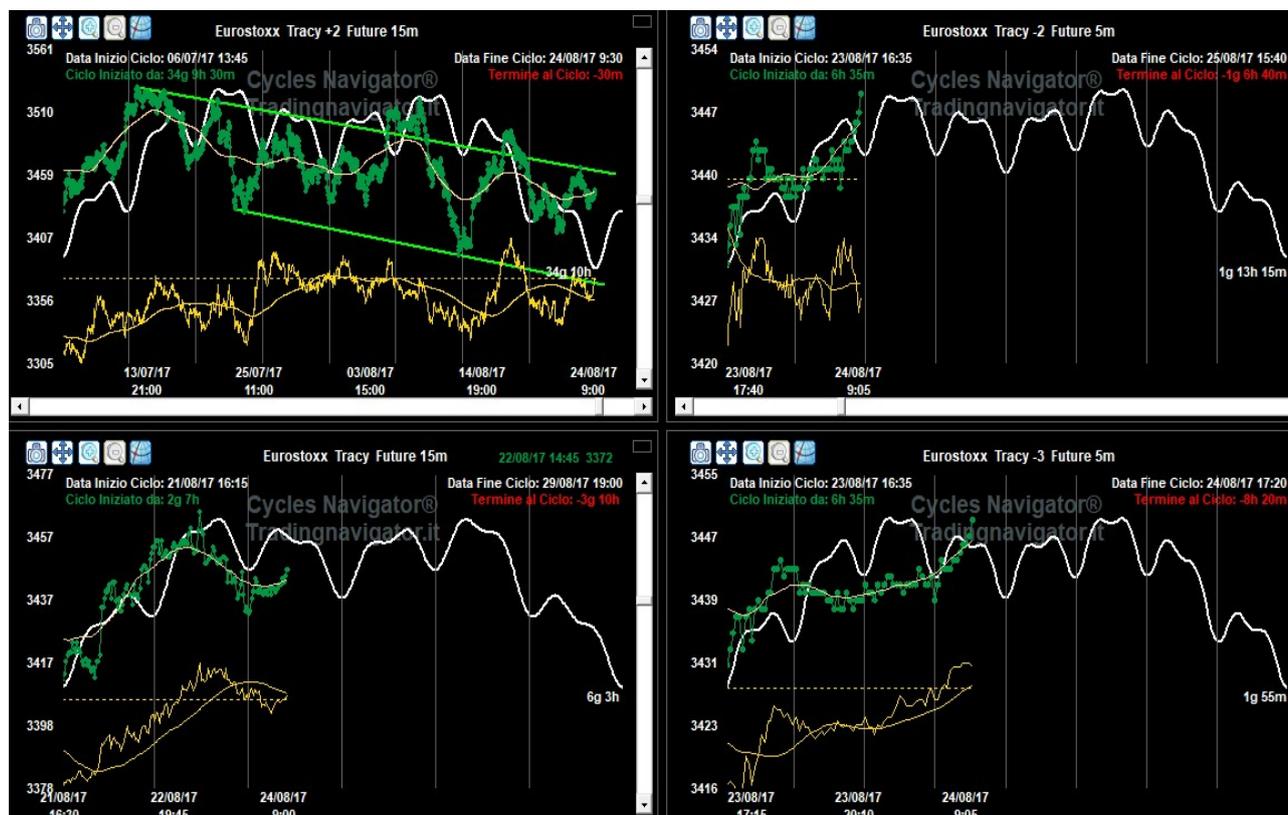
L'effetto generale per l'inizio della mattinata sui mercati Europei (tenendo conto dei pesi e delle correlazioni dei vari Indici Asiatici) è da considerarsi Neutrale.

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

Come dati sensibili per i Mercati Finanziari abbiamo:

- Pil Spagna (ore 09:00)
- Pil UK (ore 11:00)
- Richiesta Sussidi Disoccupazione Usa (ore 14:30).
- Vendita Abitazioni Esistenti Usa (ore 16:00).

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 24 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 valutazione 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” che possono avere alterato la struttura. E’ atteso un ulteriore leggero indebolimento che potrebbe portare ad una conclusione ciclica con l’attuale sotto-ciclo Settimanale o a limite con il successivo.

- in basso a sx c'è il Ciclo Settimanale (o Tracy -dati a 15 minuti)- è partita una nuova fase sui minimi del 21 agosto pomeriggio. Potremmo avere 1 gg a leggera prevalenza rialzista (o lateralità) e poi almeno 2 gg di debolezza.

- in alto a dx c'è il Ciclo bi-Giornaliero (o Tracy-2 -dati a 5 minuti- è un ciclo meno importante)- è partito il 23 agosto intorno alle ore 16:30 e non ha particolare forza. Potrebbe proseguire così.

- in basso a dx c'è il Ciclo Giornaliero (o Tracy-3 -dati a 5 minuti)- è partito ieri intorno alle ore 16:30 e non ha particolare forza. Potrebbe proseguire senza particolare forza per poi trovare un minimo conclusivo entro le ore 17 di oggi.

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

- un leggero rafforzamento può portare a:

- Eurostoxx: 3485- 3500- 3535

- Dax: 12265-12330-12400

- Fib: 21750- 22000- 22250

- miniS&P500: 2448-2455-2465-2475

Valori oltre quello sottolineato sarebbero un primo segnale di una ripresa di forza sui cicli superiori e di un possibile nuovo Trimestrale, confermato dal raggiungimento del livello successivo

- dal lato opposto un ulteriore indebolimento può portare a:

- Eurostoxx: 3425- 3410-3388

- Dax: 12100- 12000-11920

- Fib: 21500-21300-21150

- miniS&P500: 2430- 420-2415-2400

Valori verso il 1° sottolineato metterebbero in debolezza anticipata il Settimanale. Valori sotto al 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	3466	8-9	3459
Eurostoxx-2	3485	9-10	3477
Dax-1	12270	16-18	12255
Dax-2	12330	21-22	12310
Fib-1	21830	45-50	21790
Fib-2	21900	45-50	21860
miniS&P500-1	2448	2,75-3	2445,5
miniS&P500-2	2455	3,25-3,5	2452

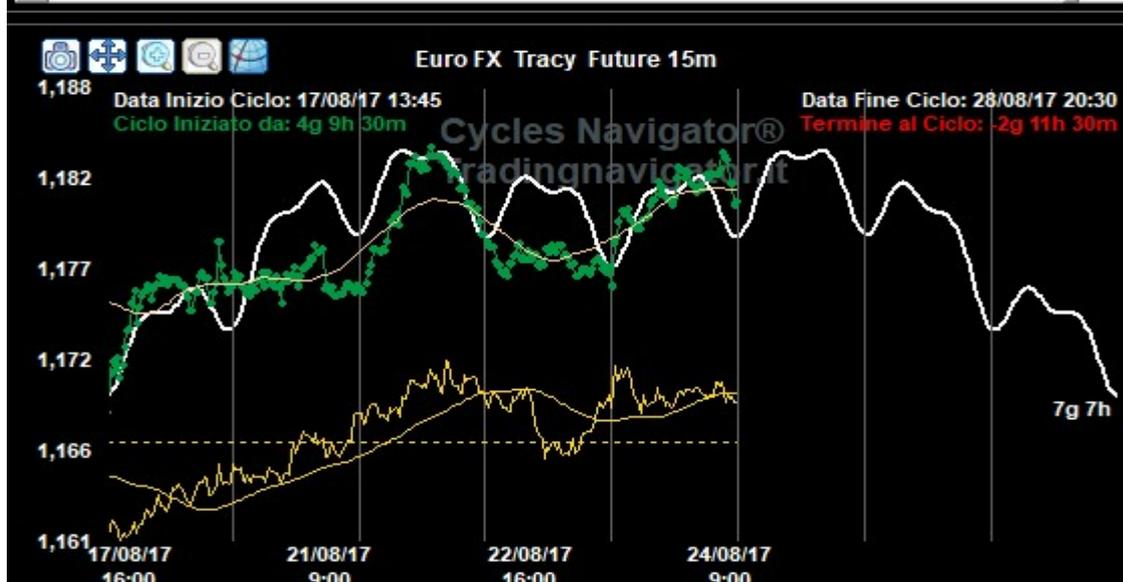
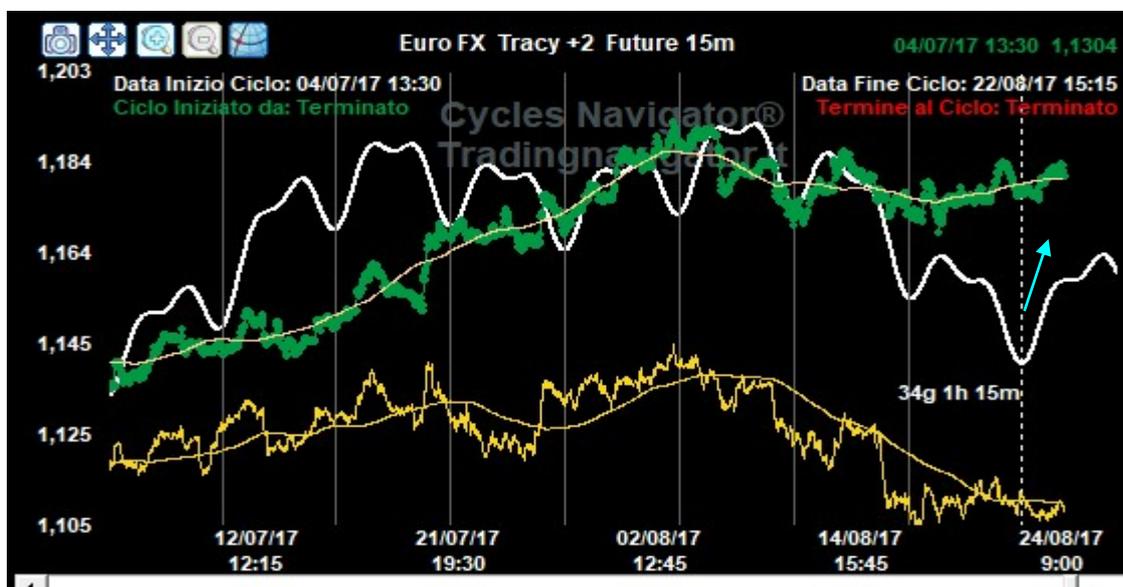
<u>Trade Ribasso</u>	<u>Vendita sotto</u>	<u>Take-Profit (punti)</u>	<u>Stop-Loss sopra</u>
Eurostoxx-1	3428	9-10	3436

Eurostoxx-2	3410	11-12	3420
Dax-1	12140	16-17	12155
Dax-2	12100	21-22	12120
Dax-3	12050	21-22	12070
Fib-1	21590	45-50	21630
Fib-2	21500	55-65	21550
miniS&P500-1	2435	3,25-3,5	2438
miniS&P500-2	2429	3,25-3,5	2432

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 24 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. Abbiamo 2 possibilità;

1- potrebbe essere terminato sui minimi di del 17 agosto- se così fosse potrebbe avere una prevalenza rialzista sino a circa l'8 settembre

2- manca ancora un leggero ribasso per andare a chiudere il ciclo entro il 28 agosto.

L'ipotesi 1 sembra prevalere.

- in basso a sx c'è il Ciclo Settimanale (o Tracy -dati a 15 minuti) – è partita una nuova fase sui minimi del 17 agosto intorno alle ore 13:40 ed ha una discreta forza, che ieri si è rinvigorita dopo la metà ciclo. Potrebbe avere 1 gg di leggera forza (o lateralità) e poi 2 gg di leggero indebolimento per andare a chiudere.

- Ciclo Giornaliero (non in grafico)– è partito ieri intorno alle ore 10:00 ed ha una buona forza. Potrebbe trovare un minimo conclusivo entro le ore 11:00. A seguire un nuovo Giornaliero atteso senza particolare forza.

A livello di Prezzi “critici” da monitorare:

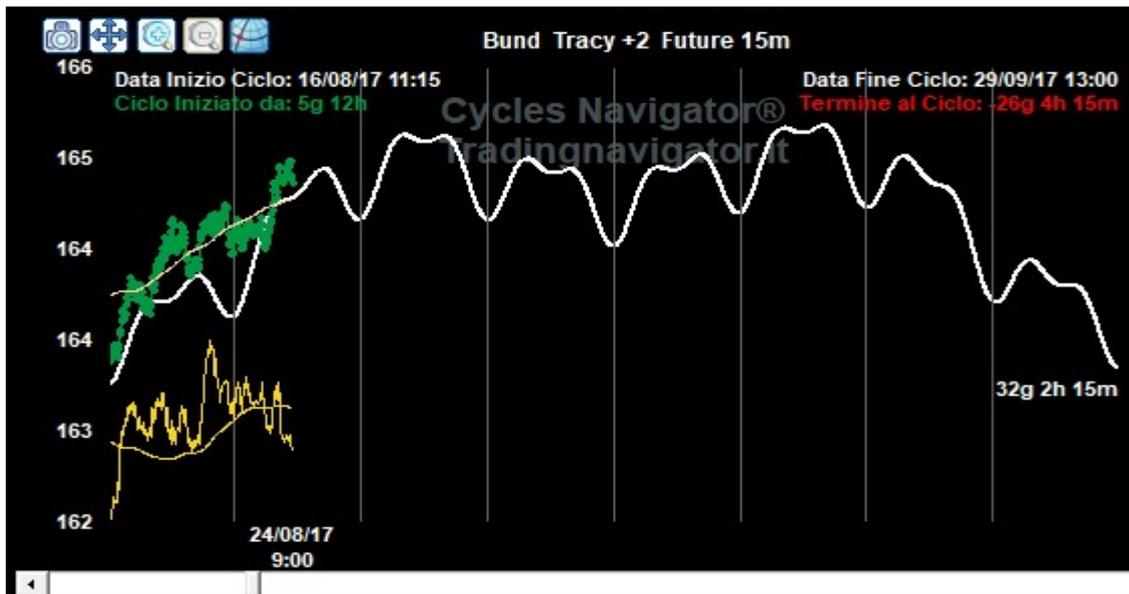
- un po' di forza può portare a 1,1825- oltre abbiamo 1,185 che confermerebbero l'ipotesi 1 del metà-Trimestrale

- dal lato opposto ci possono essere correzioni a 1,1775 e sino a 1,174- valori inferiori toglierebbero forza al Settimanale e si potrebbe proseguire verso 1,170.

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>	1,1825	0,0014-0,0015	1,1812
<u>Trade Rialzo-2</u>	1,1850	0,0016-0,0017	1,1835
	<u>Vendita sotto</u>	<u>Take-Profit</u>	<u>Stop-Loss sopra</u>
<u>Trade Ribasso-1</u>	1,1775	0,0014-0,0015	1,1788
<u>Trade Ribasso-2</u>	1,1740	0,0016-0,0017	1,1755

Vediamo ora la situazione Multi-Ciclica per il Bund future (dati aggiornati alle ore 09:05 di oggi 24 agosto):



- in alto a sx c'è il metà-Trimestrale o Mensile (o Tracy+2 -dati a 15 minuti) – è partito sui minimi del 16 agosto ed ha una buona forza. Potrebbe mantenere una prevalenza rialzista sino ad inizio settembre- poi si valuterà.

- Ciclo Settimanale (o Tracy -dati a 15 minuti) – è partito sui minimi del 16 agosto intorno alle ore 11:45 e mantiene una buona forza che ha allungato i tempi ciclici. Potrebbe iniziare ad indebolirsi per trovare un minimo conclusivo entro domani pomeriggio.

- Ciclo Giornaliero (non in grafico) – è partito ieri intorno alle ore 10:55 ed ha una buona forza. Potrebbe leggermente indebolirsi per trovare un minimo conclusivo entro le ore 12. A seguire un nuovo Giornaliero atteso leggermente debole.

A livello di Prezzi “critici” da monitorare:

- un po' di correzione può portare a 164,5-164,2-164

- dal lato opposto una ulteriore forza (un po' a sorpresa) può portare a 165 e ciò allungherebbe ulteriormente il ciclo.

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	164,90	0,09-0,10	164,82
	Vendita sotto	Take-Profit	Stop-Loss sopra
Trade Ribasso-1	164,50	0,09-0,10	164,58
Trade Ribasso-2	164,20	0,11-0,12	164,30

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).