

Quest'oggi vi voglio rendere partecipi del nostro successo

Cos'è un trading system?

E' una metodologia operativa fondata su regole fisse, oggettive, ottimizzate, sulla base di una programmazione fatta a monte e costantemente aggiornata.

Attraverso questo processo possiamo eliminare a priori tutti quei fattori emotivi e di valutazione soggettiva che nel tempo si rivelano deleteri al fine di raggiungere un risultato prefissato.

Come operare con un trading system?

L'applicazione di un trading system nella pratica è molto variegata. C'è chi tenta la fortuna, rischiando oltre dovuto per poi soccombere nelle fasi critiche e chi invece come me ha un approccio scientifico, al fine di raggiungere l'obiettivo finale, ossia avere dei ritorni ben superiori alla media.

Gli strumenti

Nel caso specifico generalmente operiamo con derivati, attraverso i cfd che a differenza dei futures danno l'opportunità di calibrare meglio il rischio, in particolar modo quando parliamo di capitali inferiori ai 200 mila euro. Con i cfd si possono personalizzare anche portafogli minimi come 2000 o 5000 euro.

Il calcolo del rischio

Nella tabella possiamo osservare come un trading system (in questo caso applicato al Dax) presenti una serie di indicatori di rischio. Tali indicatori sono essenziali al fine di calibrare al meglio l'operatività di un singolo portafoglio.

Esempio: se la massima perdita da un livello top del TS sarà del 10% dovrò mettere in conto il fatto di rischiare quantomeno quella percentuale. Pertanto, se lavorerò con una leva di 3 volte superiore al portafoglio, questo rischio massimo si tradurrà non più nel 10%, bensì nel 30%. Ovviamente l'obiettivo sarà

quello di guadagnare, mettendo in conto il rischio massimo, al fine di sopravvivere nelle fasi critiche che un trading system potrà attraversare, consapevoli che prima o dopo arriverà la fase più redditizia e divertente., che generalmente è prevalente nella vita dell'investimento.

L'approccio errato

La maggioranza delle persone che si avventurano nel mondo dei derivati e degli strumenti a leva, altamente speculativi, finisce per soccombere. La percentuale di conti perdenti presso le principali società di brokeraggio sfiora il 70%, mentre solo una percentuale compresa tra il 2 e il 5 per cento riesce ad ottenere risultati eccellenti.

Molti infatti approdano a tali mercati con l'ingordigia di guadagnare nel tempo più veloce possibile, affascinati dalla possibilità di muovere capitali ben superiori a quello posseduto.

Con i cfd o i future si può comprare 100 mila euro possedendo solo 1000 euro. Pertanto una variazione dell'1% comporterà un plus o un minus di 1000 euro, pari al 100% del capitale investito. Questa possibilità fa sì che molti vengano affascinati da tale opportunità, facendo entrare in gioco fattori emotivi quali l'avidità, la paura e l'irrazionalità. L'approccio giusto per soccombere.

L'approccio corretto

Anch'io fino a qualche anno fa appartenevo a quel 70% o quantomeno non al club ristretto del 2 o 5 per cento che consegue risultati eccellenti. Ero consapevole che una metodologia sistematica mi avrebbe portato ad ottenere performance di tutto rispetto, ma ero troppo preso dall'avidità e dalla convinzione di quello che stavo facendo. Il confine per entrare nell'effetto videopoker era molto vicino, e solo un istante prima di entrarci mi sono messo ad elaborare sistemi operativi sulla base degli studi di analisi tecnica che mi avevano accompagnato nel corso della mia lunga vita lavorativa.

Per prima cosa ho messo da parte l'avidità e la voglia di rivalse nei confronti del mercato,

dopo di che

ho iniziato una lunga programmazione aiutato da un mio attuale collaboratore laureato in informatica, il dott. Andrea Tironi, con il quale abbiamo sviluppato e ottimizzato un sistema operativo, applicabile e adattabile a qualsiasi asset di mercato, dagli indici alle valute per finire alle commodity.

Finito il tutto sono passato alla fase di test per alcuni mesi per poi iniziare il lungo viaggio.

I risultati ottenuti a distanza di 10 mesi sono stati esponenziali, e con estrema certezza lo saranno ancora di più in futuro, in quanto alla base vi è una costante ricerca al fine di migliorare e ottimizzare i sistemi utilizzati.

Ma la cosa più bella di tutto ciò non sono stati i soldi guadagnati, bensì il veder realizzarsi quel disegno che avevamo solo teorizzato e poi testato.

Ancora più affascinante l'affiatamento fra me e i miei collaboratori, con i quali ci confrontiamo e ci incitiamo a vicenda nei momenti in cui è arrivato il momento di affrontare quelle fasi avverse attraverso le quali possiamo solo crescere..... Guai ad abbattersi

Cosa aspettarsi?

Ad essere sincero il viaggio è iniziato quasi per gioco, ma anche in quel caso quel poco che ho destinato è stato calibrato secondo una metodologia scientifica.

Inizialmente avevo stabilito di operare sul Dax index per un importo pari a dieci volte la cifra investita, consapevole che una perdita massima del 10% sul trading system di base avrebbe portato all'azzeramento del capitale. Questo era il rischio massimo. Le cose sono andate diversamente, visto che il trading sistem di base ha guadagnato il 30 per cento in circa 7 mesi. Quindi avevo triplicato la cifra investita. Questo grazie all'aver mantenuto una disciplina corretta e costante nel tempo.

Adesso che la cifra è diventata più importante, la cosiddetta leva è stata portata da 10 a 3, nel senso che fatto 100 opero per un cifra pari a 300 e non a 1000 come inizialmente, almeno per quanto riguarda un singolo prodotto.

In realtà il trading system è stato ampliato ad altri asset. Oltre che al Dax, lo applico al Gold e all'Eurusd. Per ciascun asset la leva massima è di 3.

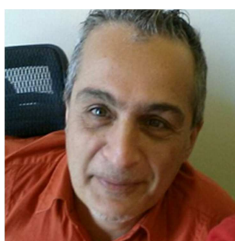
Complessivamente, nel caso che tutti e tre gli asset siano operativi a pieno regime la leva massima sul portafoglio sarà di 9 volte il capitale investito.

Quando un sistema vedrà un periodo di sofferenza, la leva scenderà sistematicamente a 1 contro 3, al fine di minimizzare le fasi di maggior perdita. Praticamente il ciclo più avverso vorrebbe i sistemi contemporaneamente in fase di sofferenza, cosa che per il fattore decorrelazione è un'ipotesi molto remota. Qualora si verificasse un evento tale, subentrerebbe una riduzione pari ai 2/3 della leva massima utilizzabile.

Le aspettative per coloro che approdano ad un sistema, qualunque esso sia devono mirare in alto, ma in un arco temporale lungo. Tradotto, significa, **pazienza, umiltà e costanza**.

Statene certe che se avete fatto bene in conti nella fase di test, i risultati non mancheranno e addirittura vi sorprenderanno.

Andrea Facchini



Dott. Andrea Tironi



