

PAOLO SERAFINI

IL MANUALE DEL TRADER IDIOTA

SECONDO VOLUME

IL PRIMO LIBRO INTERATTIVO CHE TI SPIEGA
DOVE COMPRARE E VENDERE IN BORSA

Paolo Serafini



RULE 72 LTD EDITORE

DOPO IL GRANDE SUCCESSO DEL PRIMO
VOLUME DEL MANUALE DEL TRADER IDIOTA,
ECCO IL SECONDO VOLUME CON I SEGRETI
IDIOTI UTILIZZATI DAI TRADER VINCENTI.

Questo manuale è dedicato a te, aspirante trader, in
cerca della tua perfetta operatività,
gestione del rischio/rendimento
e miglioramento nella psicologia del trading.

Questo manuale ha esclusivamente scopo didattico. Pertanto NON deve essere inteso in alcun modo come consiglio operativo di investimento, né come sollecitazione alla raccolta di pubblico risparmio. I risultati presentati, reali o simulati, non costituiscono alcuna garanzia relativamente a ipotetiche performance operative future. L'attività di trading speculativo comporta notevoli rischi economici e chiunque lo svolga lo fa sotto la propria esclusiva responsabilità, pertanto gli autori non si assumono alcuna responsabilità circa eventuali danni diretti o indiretti relativamente a decisioni di investimento prese dal lettore. Lo spettatore pertanto esonera questo sito e chi lo alimenta, nei limiti di legge, da qualsiasi responsabilità comunque connessa o derivante dal presente manuale.

A norma della legge sul diritto d'autore e del codice civile, è vietata la riproduzione di questo manuale o di parte di esso con qualsiasi mezzo, elettronico, meccanico, per mezzo di fotocopie, microfilms, registrazioni o altro.

Editore: Rule 72 Ltd

Autore: Paolo Serafini

Ultima modifica 31 maggio 2013

IL MANUALE DEL TRADER IDIOTA secondo volume

Paolo Serafini
Gaspare e
Max W. Soldini

IL MANUALE DEL TRADER IDIOTA

secondo volume

INDICE GENERALE

Pag.6: Come acquisire la disciplina e la psicologia

Pag.8: Terzo pattern grafico: Hunter Stop

Pag.37: Big Hunter Stop

Pag.58: Analisi di alcune figure grafiche particolari

COME ACQUISIRE LA DISCIPLINA E LA PSICOLOGIA

Sento spesso parlare del fattore fortuna nel trading: chi guadagna è fortunato, chi perde è sfortunato. Non è assolutamente vero infatti se si vuole fare del trading il proprio lavoro, bisogna acquisire molta disciplina e controllo dell'aspetto psicologico. Se il trading dipendesse dalla fortuna ci sarebbero delle giornate positive alternate a quelle negative avendo sempre una probabilità di riuscita del 50%. Dalla mia quotidiana esperienza sui mercati posso affermare che i guadagni sono solo il frutto di tantissime componenti.

Paolo Borsellino diceva **che chi ha paura muore ogni giorno e chi non ne ha muore una volta sola**. La paura ci pervade nel mondo del trading e non solo, come si fa realmente a sconfiggerla o a tenerla sotto controllo? Quest'intensa emozione ci limita in maniera incredibile in tutto ciò che facciamo, anche molto di più di quello che possiamo pensare, in pratica ci priviamo delle nostre capacità ad ogni livello, spesso ci fa prendere decisioni sbagliate. Prendere coscienza di questa sensazione ci darà una grandissima sicurezza e ci aiuterà in tutte le azioni successive. Quando giocavo a tennis avevo sempre paura del mio avversario e paura di sbagliare. Non ero quindi concentrato sulla strategia utile a batterlo. Con l'esperienza sono riuscito a tenere sotto controllo le mie paure. Da quel momento i risultati sono cambiati in maniera considerevole e spesso sono riuscito ad avere la meglio su giocatori che tecnicamente erano nettamente superiori a me. Il mio consiglio è quindi quello di cercare di conoscere se stessi, i propri errori, le proprie emozioni e le proprie reazioni allo stress in modo da riuscire a controllarle e a conviverci senza esserne sopraffatti.

Ulisse si fece legare all'albero maestro della nave per non essere ammaliato dal canto delle sirene. Allo stesso modo noi dobbiamo simbolicamente "farci legare alla sedia" per non essere trascinati dalle nostre emozioni e per non ascoltare i suggerimenti dettati dalla nostra emotività. Deve prevalere la razionalità sulle emozioni. Come diceva giustamente Joe Ross, si deve fare trading su ciò che realmente si vede e non su ciò che si pensa. Le decisioni devono essere prese solo a seguito dell'attenta osservazione dei grafici. Non ci si deve far condizionare da tanti indicatori ed oscillatori. Come più volte evidenziato l'unico elemento da tenere in considerazione per la nostra operatività deve essere lo stop loss. Solo in questo modo le perdite potranno essere contenute e si potrà acquisire la fiducia necessaria ad incrementare i possibili profitti. Le perdite ci saranno sempre, non si riuscirà mai ad annullarle, ma se queste saranno limitate, si riuscirà a recuperarle rapidamente con le operazioni successive.

Nel mondo del trading esiste la possibilità di adoperare piattaforme demo. In commercio ne esistono tantissime. Con queste piattaforme ci si potrà esercitare continuamente e senza problemi di coinvolgimento emotivo. Una volta riusciti ad avere dei risultati positivi in demo e dopo aver acquisito sicurezza in se stessi si può accedere all'operatività reale. Quando si opera con il denaro reale è evidente che l'emozione è forte ma non mi stanco di ripetere di usare la ragione e di accantonare le emozioni. Il consiglio che mi sento di dare ai neofiti del trading è quello di iniziare con piccoli capitali. Essere sottocapitalizzati non è un bene ma per imparare è la cosa migliore in quanto consente di acquisire l'esperienza necessaria ad operare in modo adeguato.

TERZO PATTERN GRAFICO: HUNTER STOP

Questo terzo pattern grafico deve essere accompagnato da 4 regole fondamentali:

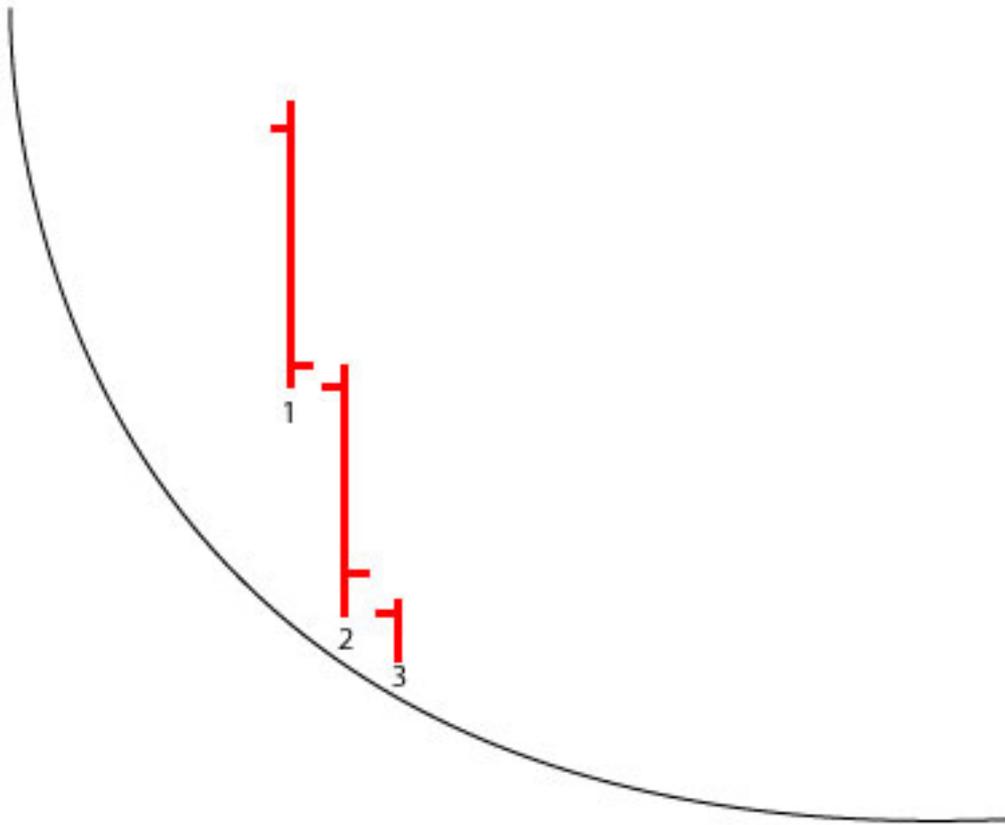
- Dobbiamo necessariamente essere in presenza di volumi, quindi possiamo fare trading a nostra scelta su qualsiasi strumento finanziario, futures, valute, azioni, materie prime, obbligazioni o derivati.
- Lo stop loss deve essere molto a ridosso dell'entrata.
- Il rischio rendimento deve essere come minimo pari 1/3 per cui rischierò 1 per guadagnare 3 (**RR**).
- Il time frame del grafico più è alto e maggiori saranno le probabilità di successo. In questo pattern non deve essere inferiore a 10 minuti, anche se ci possono essere delle opportunità interessanti anche su time frame inferiori.

Rispetto al calicetto dobbiamo trovarci nelle parti estreme delle bande di Bollinger, per cui le possibili entrate saranno quantitativamente minori. Per l'individuazione del target verranno presi in considerazione i livelli delle barre precedenti. Lo stop loss, componente fondamentale dell'operatività, deve essere impostato sotto la barra di ingresso, quella in formazione. In questo modo la perdita massima possibile risulterà contenuta.

Rispetto agli altri pattern, in questa figura grafica i market mover spesso cercano di rompere dei minimi o dei massimi importanti, seppur di poco, solo per far scattare gli stop loss per poi riprendere la precedente direzione del trend. Nel grafico in basso sono riportati vari esempi, sia di operatività short che di operatività long.

Hunter stop sui minimi

Figura n. 1



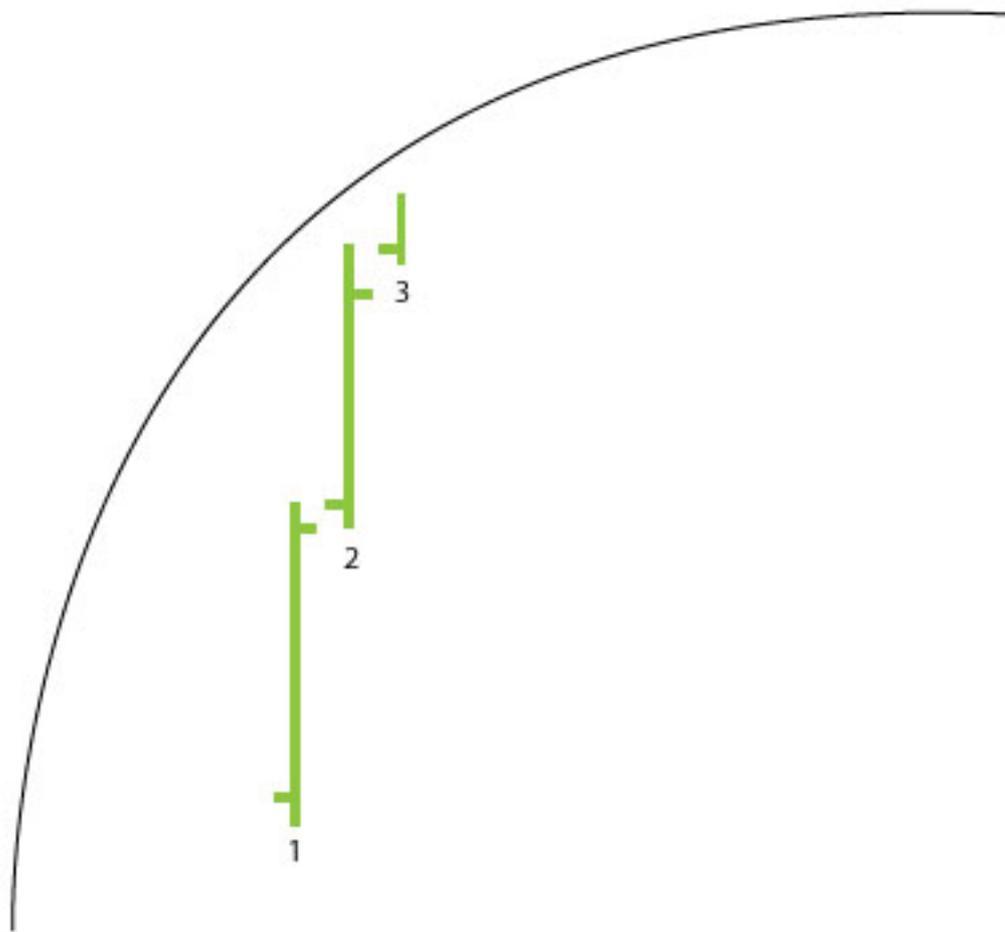
Ci troviamo nella parte inferiore delle bande di Bollinger. L'entrata in buy sarà sulla barra numero 3 dopo che la stessa avrà rotto il minimo della barra numero 2. Si compra con prezzo limite 1 tick sopra il minimo della barra numero 2. Lo stop sarà collocato 1 tick sotto il minimo della barra numero 3. In questo caso la differenza tra il minimo della barra numero 3 e il minimo della barra numero 2 non deve essere superiore a 3 tick poiché essendo l'entrata 1 tick al di sopra del minimo della barra numero 2 e lo stop collocato 1 tick sotto il minimo della barra numero 3 si rischierebbe solamente uno stop di 5 tick, in perfetta linea con le entrate di tutti gli altri pattern.

Facendo un esempio in termini di calcolo, se il minimo della barra numero 2 fosse di 12 euro e il nuovo minimo della barra numero 3 fosse di 11,97, l'entrata avverrebbe nella barra numero 3 successivamente al recupero del minimo della barra numero 2 (cioè quando supera di 1 tick al rialzo la barra numero 2), in questo specifico caso sarà a 12,01. Lo stop sarà collocato sotto (di 1 tick) il nuovo minimo per cui a 11,96 con conseguente perdita massima possibile di 5 tick.

Nel caso in cui il minimo della barra numero 3 fosse stato a 11,96 (o inferiore a questa cifra) e il minimo della barra numero 2 fosse stato sempre 12 euro, non sarei entrato poiché lo stop sarebbe stato in quest'ultimo caso di 6 tick (o superiore) non rispettando la mia strategia operativa che prevede come tetto massimo di perdita possibile 5 tick.

[Clicca su questo link per vedere la Video-spiegazione di Paolo Serafini del grafico](#)

Hunter stop sui massimi
Figura n. 2



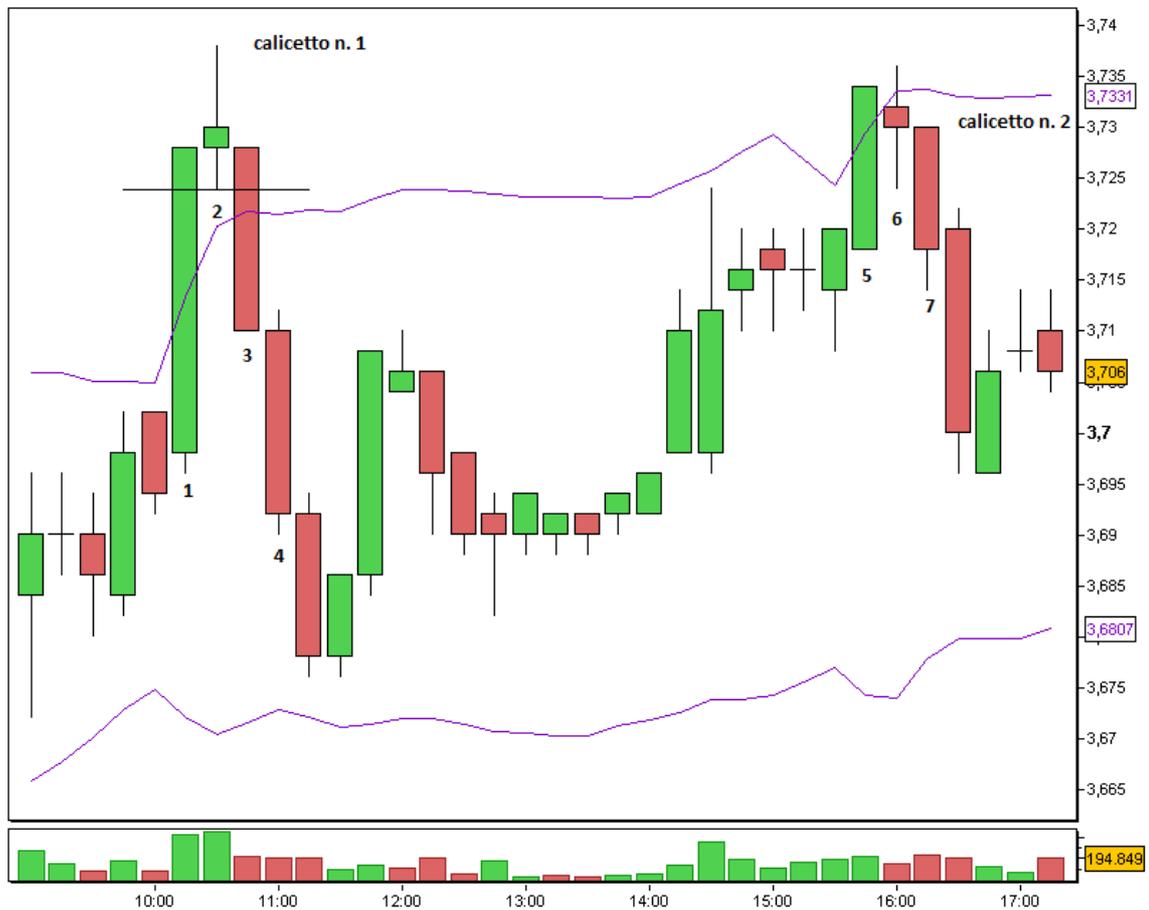
Ci troviamo nella parte superiore delle bande di Bollinger. L'entrata in sell sarà sulla barra numero 3 dopo che la stessa avrà rotto il massimo della barra numero 2. Si vende con prezzo limite 1 tick sotto il massimo della barra numero 2 e lo stop sarà collocato 1 tick sopra il massimo della barra numero 3. In questo caso la differenza tra il massimo della barra numero 3 e il massimo della barra numero 2 non deve essere superiore a 3 tick poiché in questo modo rischierei solamente uno stop di 5 tick, in perfetta linea con le entrate di tutti gli altri pattern.

Facendo un esempio in termini di calcolo, se il massimo della barra numero 2 fosse di 12 euro e il nuovo massimo della barra numero 3 fosse di 12,03, l'entrata dovrebbe avvenire nella barra numero 3 successivamente al recupero del massimo della barra numero 2 (cioè quando scende di 1 tick rispetto al massimo della barra numero 2) cioè a 11,99. Lo stop sarà collocato (1 tick) sopra il nuovo massimo per cui a 12.04 con conseguente perdita massima possibile di 5 tick.

Nel caso in cui il massimo della barra numero 3 fosse a 12,04 (o superiore a questa cifra) e il massimo della barra numero 2 fosse sempre 12 euro, non sarei entrato poiché lo stop sarebbe stato in quest'ultimo caso di 6 tick (o superiore) e questo andrebbe a scontrarsi con la mia strategia operativa che prevede come tetto massimo di perdita possibile uno stop di 5 tick.

[Clicca su questo link per vedere la Video-spiegazione di Paolo Serafini del grafico](#)

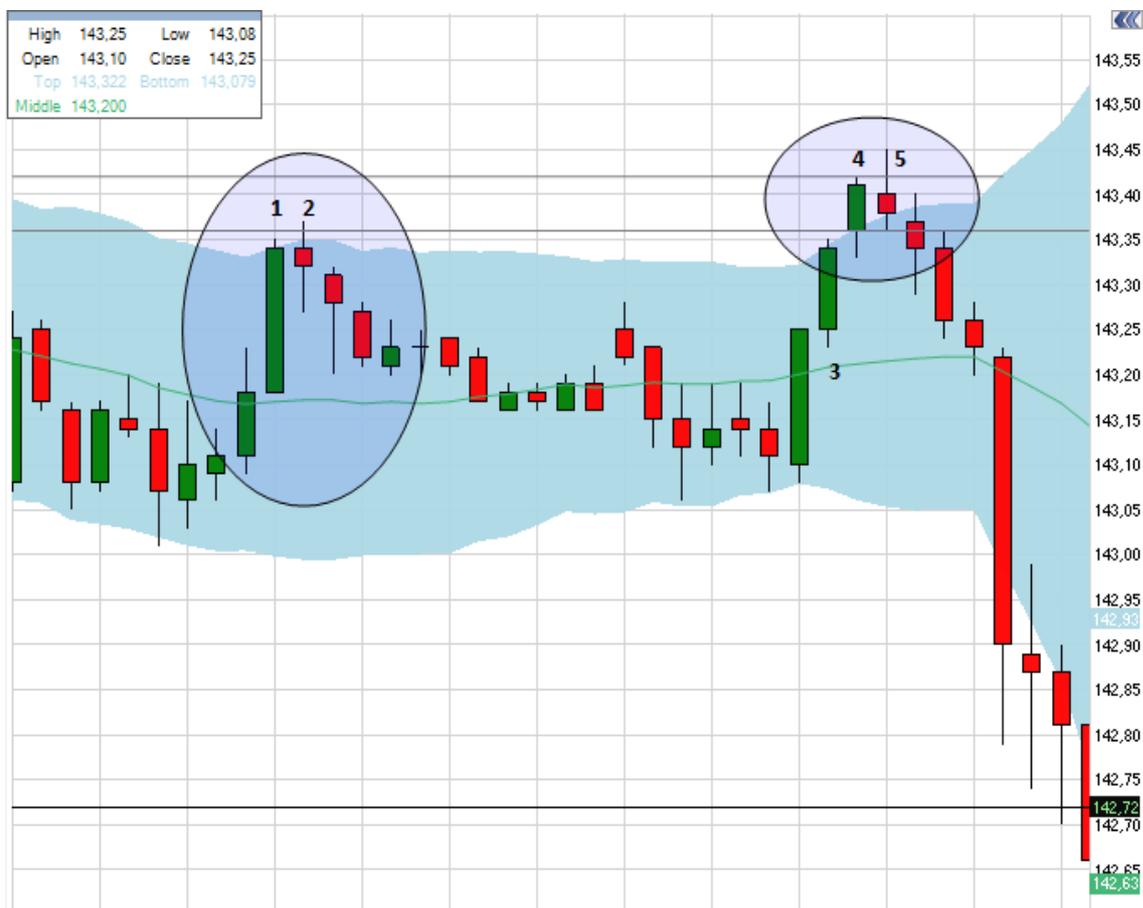
Hunter stop sui massimi
Figura n.3: Ubi Banca



Prima di continuare con gli esempi su questo tipo di pattern, vorrei soffermarmi brevemente sul grafico numero 3 già analizzato nel libro relativamente alla spiegazione del calicetto. Nella barra numero 3 si entra nell'operazione a seguito dell'individuazione del pattern del calicetto e essendo soddisfatti i requisiti di **RR**. Nella barra numero 7, anche se il rendimento si sarebbe potuto cogliere, l'entrata per l'individuazione del pattern del calicetto non sarebbe stata possibile per via dello stop molto ampio. In questo caso l'entrata sarebbe potuta avvenire nella barra numero 6 (Hunter stop sui massimi) al recupero del massimo della barra numero 5 e in questo caso l'operazione sarebbe andata a buon fine. In questa entrata le caratteristiche erano completamente soddisfatte, sia in riferimento allo stop molto ravvicinato all'entrata, che riguardo al nostro **RR**.

Hunter stop

Figura n. 4: Future Bund 30 minuti 6 e 7 marzo 2013



Prima operazione. Nella figura numero 4 ci troviamo nella parte alta delle bande di Bollinger e precisamente al di fuori delle stesse. La barra numero 1 forma un minimo a 143,18 ed un massimo a 143,35. La barra numero 2 apre a ridosso della chiusura della barra numero 1, sale sopra il massimo della barra numero 1 fino a toccare un massimo a 143,37. L'entrata short sarà 1 tick sotto il massimo della barra numero 1 e precisamente a 143,34. Lo stop sarà posto al di sopra del massimo della stessa barra numero 2 a 143,38. In questo caso l'operazione non va in stop e il profit sarà del triplo rispetto allo stop loss. Con uno stop di 4 tick il target sarà di 12 tick di gain.

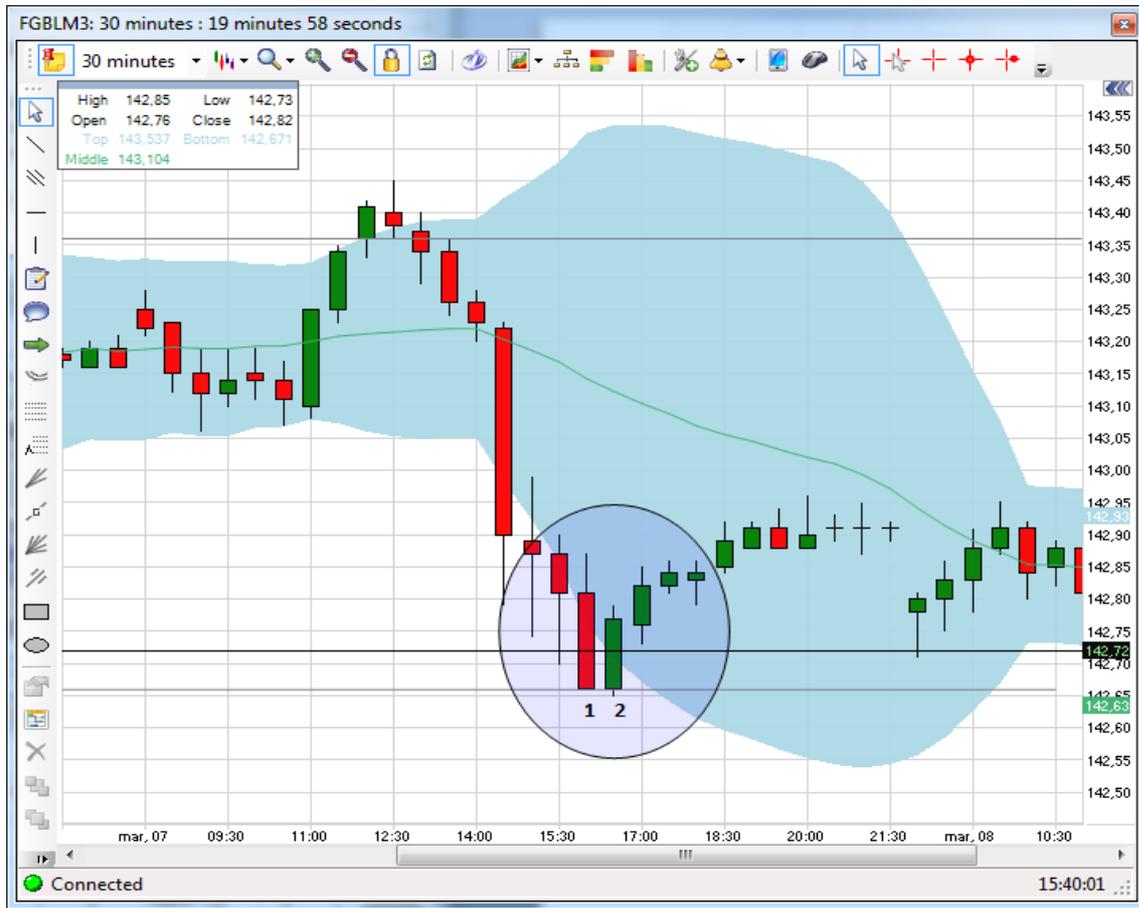
Seconda operazione. Sempre nel grafico numero 4, nella barra numero 4, il Bund determina un massimo a 143,42. Nella barra numero 5 il massimo è situato a 143,45 proprio al limite della nostra entrata. La differenza tra i massimi delle barre numero 4 e numero 5 è di 3 tick. Possiamo quindi entrare sulla barra numero 5, 1 tick sotto il massimo della barra numero 4 a 143,41. Lo stop sarà posto sopra il massimo della barra numero 5 a 143,46. Con uno stop di 5 tick, il target dovrà essere di 15 tick.

Nel corso del libro affronterò anche le dinamiche del take profit ma per ora porto l'operazione a target uscendo una volta raggiunti i 15 tick di gain.

Se tra il massimo della barra numero 4 e il massimo della barra numero 5 ci fossero stati più di 3 tick non avrei aperto l'operazione poiché lo stop loss sarebbe stato superiore a 5 tick, non conforme quindi alle mie strategie operative che prevedono stop molto stretti.

Hunter stop

Figura n. 5: Future Bund 30 minuti 7 marzo 2013



Sempre sul Bund il 7 marzo 2013, tra le 15.30 e le 17, si forma un minimo importante nella barra numero 1 ampia ben 21 tick (massimo a 142,87 e minimo a 142,65). Calcolando uno stop massimo di 5 tick, il target previsto nel caso di recupero della barra numero 1 sarebbe di 21 tick. Si prospetta quindi una profittevole entrata: nella barra numero 2 si determina un minimo a 142,65, l'ingresso sarà a 142,67 al recupero del minimo della barra numero 1. Lo stop sarà posto sotto il minimo della barra numero 2 a 142,64 e non sarà colpito. Il target, triplo rispetto alla massima perdita possibile, sarà ampiamente raggiunto.

In questi primi esempi su questo tipo di pattern ho voluto evidenziare la necessità di individuare lo stop loss che non sia superiore a 5 tick. Naturalmente ricercando queste condizioni le operazioni saranno quantitativamente limitate essendo il time frame in questione di 30 minuti. Nel mio precedente libro "The Scalper" non avevo evidenziato l'importanza sull'uso di un time frame piuttosto di un altro ma è invece necessario sottolineare che più è alto il time frame maggiori saranno le probabilità di successo soprattutto su questi strumenti finanziari (futures, valute o commodities). Con time frame alti non si rischia di andare in over trading (cioè di aprire e chiudere tantissime operazioni) con la possibile conseguenza di accusare tantissime perdite o piccoli guadagni e facendo solo gli interessi della banca generando tantissime commissioni. Le entrate devono essere mirate, è necessario aspettare i segnali **migliori** con dedizione e pazienza, senza rincorrere il mercato. Con il tempo e l'esperienza i risultati non tarderanno ad arrivare.

Su questa figura grafica vanno benissimo anche i time frame giornalieri, anzi a volte sono i migliori e la gestione dell'operazione deve essere mantenuta in portafoglio per

alcuni giorni se non scatta lo stop. Il nome che ho dato a questo pattern è proprio Hunter stop poiché il market mover cerca di creare un movimento che arrivi a ridosso del minimo del giorno precedente in modo da creare confusione e far scattare gli stop. Trascina il titolo poco al di sotto di quei minimi (o massimi) per poi farlo risalire (o scendere) per farci entrare a prezzi superiori (o inferiori in caso di short), proprio quando sta liquidando parte delle azioni acquistate sui minimi o vendute sui massimi.

Se riusciremo ad individuare la psicologia di chi muove il mercato riusciremo a tradurre tutti quei movimenti artificiosi che non siamo mai riusciti a decifrare fino a quel momento.

All'inizio del libro avevo proprio accennato a questo: l'importanza di capire i nostri punti deboli e capire l'avversario per aumentare la probabilità di vittoria. In caso contrario annasperemo tutti i giorni e non saremo mai capaci di capire i piccoli segnali che il mercato ci lancia costantemente.

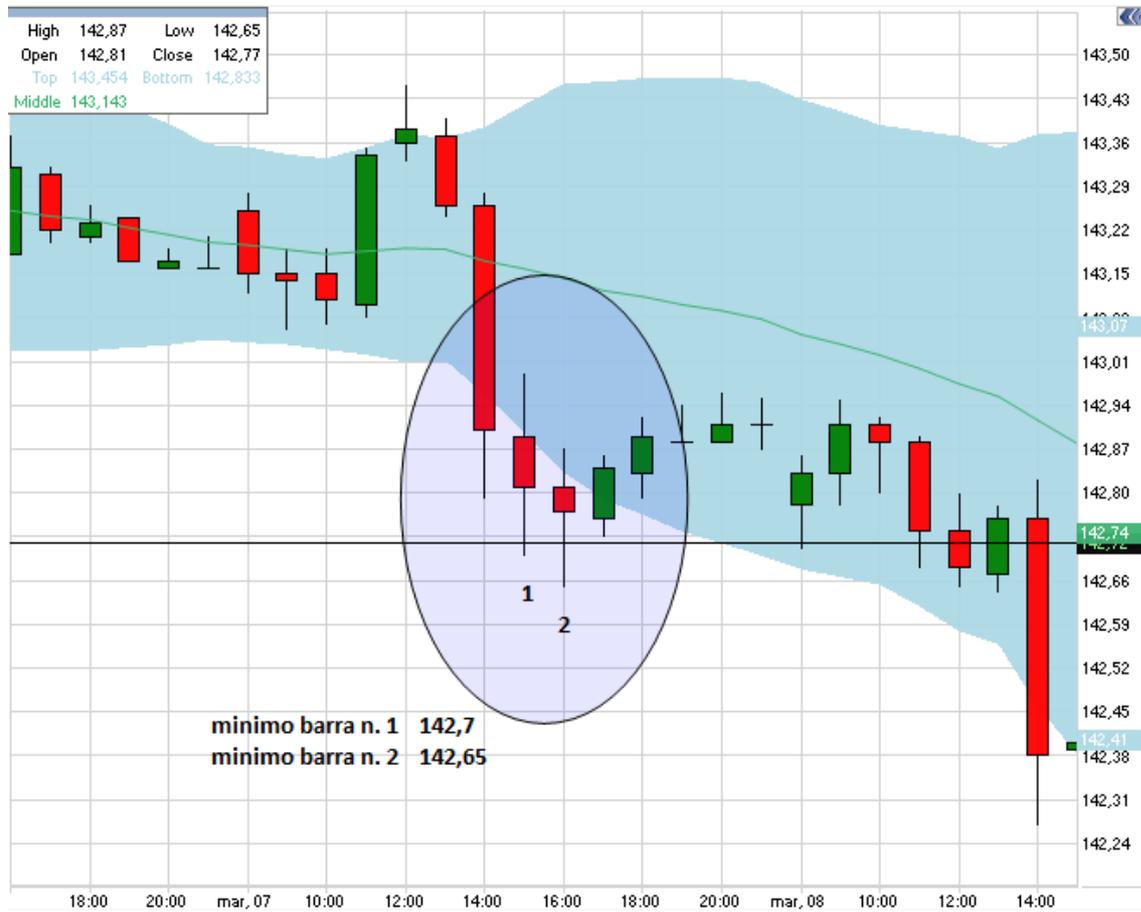
Hunter stop

Figura n.6 Future Bobl e Bund grafico orario 7 marzo 2013



Hunter stop

Figura n. 7 Future Bobl e Bund grafico orario 7 marzo 2013



Lo Shatz, il Bobl e il Bund sono il corrispettivo tedesco dei nostri Btp, staccano una cedola annuale anziché semestrale, e tra di loro differiscono soltanto per la scadenza. Lo Shatz riguarda titoli a tasso fisso (con cedole annuali) e scadenza a 2 anni. Il Bobl riguarda titoli a tasso fisso (con cedole annuali) e scadenza a 5 anni. Il Bund riguarda titoli a tasso fisso (con cedole annuali) e scadenza a 10 anni.

La maggior parte dei trader trade il Bund, ma non sono da sottovalutare anche le altre 2 scadenze. I grafici sono molto simili, per esempio nella giornata del 7 marzo 2013 sia il Bund che il Bobl riescono a recuperare il minimo della barra precedente. In questo caso sarei entrato solo sul Bobl al prezzo di 125,51 con stop sotto il minimo della barra numero 2 a 125,47 poiché lo stop sarebbe stato di 4 tick. Nel Bund invece lo stop sarebbe stato di 7 tick talmente oneroso da non permettere di entrare a mercato. L'entrata sarebbe stata al prezzo di 142,71 sulla barra numero 2 al recupero del minimo della barra numero 1 con stop 1 tick sotto il minimo della barra numero 2 a 142,64.

Una situazione simile è riscontrabile sui future degli indici americani. Controllando il future del Dow Jones, del Nasdaq e dell' S&P 500, se l'entrata corrisponde ai miei requisiti di stop allora la intraprendo, altrimenti non eseguo l'ordine. Potrebbe verificarsi il caso in cui vedo dei minimi ravvicinati su time frame abbastanza alti, la mia attenzione sarà incentrata quindi su quel minimo che produce meno perdita in caso di stop.

Hunter stop

Figura n. 8: Future Euro Stoxx 30 minuti 7 marzo 2013



Ci troviamo nella parte superiore delle bande di Bollinger, il grafico è a 30 minuti ed è un buon time frame su questo tipo di figura grafica. La barra numero 1 determina un massimo a 2731, l'entrata scatta nella barra numero 2 una volta che la stessa rompe di poco il massimo della numero 1 e ridiscende di 1 tick da quel livello. L'operazione short scatta al prezzo di 2730. Lo stop sarà posizionato 1 tick sopra il massimo della barra numero 2 a 2733. Successivamente portando lo stop alla pari (o con 1 tick di gain), riesco a evitare la chiusura in stop loss nella barra numero 3. In questa barra viene rotto il massimo della numero 2 e si registra un nuovo massimo a 2735.

Proprio sulla barra numero 3 riesco ad aprire una nuova operazione, al recupero del massimo della barra numero 2. Rientro short, precisamente a 2731 con stop 1 tick sopra il massimo della barra numero 3 a 2736. L'operazione va a buon fine.

La cosa peggiore che si possa fare quando si apre un'operazione, è quella di tramutare un bel guadagno in perdita. Nel caso del primo short (operazione con l'entrata short nella barra numero 2 al recupero del massimo della barra numero 1) avrei inserito uno stop profit nella barra numero 2 una volta che la stessa avesse raggiunto un gain di circa 5 tick. Nel future dell'Euro Stoxx, uno scatto del tick equivale a 10 euro di gain o di perdita. Avrei quindi innalzato lo stop a 10 euro di gain una volta che l'operazione fosse arrivata al guadagno di 50 euro (5 tick). Nel caso specifico non avrei subito una perdita e l'innalzamento dello stop mi avrebbe portato un piccolo guadagno.

Un altro punto che mi preme sottolineare, specialmente per chi vuole fare del trading il proprio mestiere, è quello di limitare le operazioni intraday. Nel caso in cui le prime due

operazioni della giornata andassero in stop, il mio consiglio è quello di non intraprendere ulteriori operazioni, in modo da non compromettere in maniera significativa il conto e quindi anche l'operatività futura. Se avessi eccessivamente insistito nelle operazioni all'inizio della mia attività, non sarei mai riuscito a mantenere intatto il capitale. Infatti se vi ricordate all'inizio usavo un capitale ridotto rispetto al totale visto che non avevo la necessaria esperienza per operare con capitali maggiori e in un modo più aggressivo.

Proprio in questo mese di marzo 2013, mi è giunta una mail di un mio allievo di 24 anni di Genova. Il suo conto era di 3000 euro, in circa 15 sedute è riuscito a portarlo a 18000 mila euro. Si era esaltato, credeva di aver imparato tutto dal mercato ed ha iniziato a non rispettare più le regole importanti che aveva imparato fino a quel momento. Questa eccessiva confidenza lo ha però distolto all'applicazione delle regole di base che fino a quel giorno aveva diligentemente seguito. Prima della famosa sedicesima seduta inseriva sempre gli stop ma quella volta aveva pensato bene di mediare la sua operazione anziché chiuderla in stop. Il mercato è andato violentemente dalla parte opposta a quella da lui prevista e il suo saldo è precipitato in maniera vertiginosa da 18000 a 800 euro e il suo broker ha chiuso l'operazione.

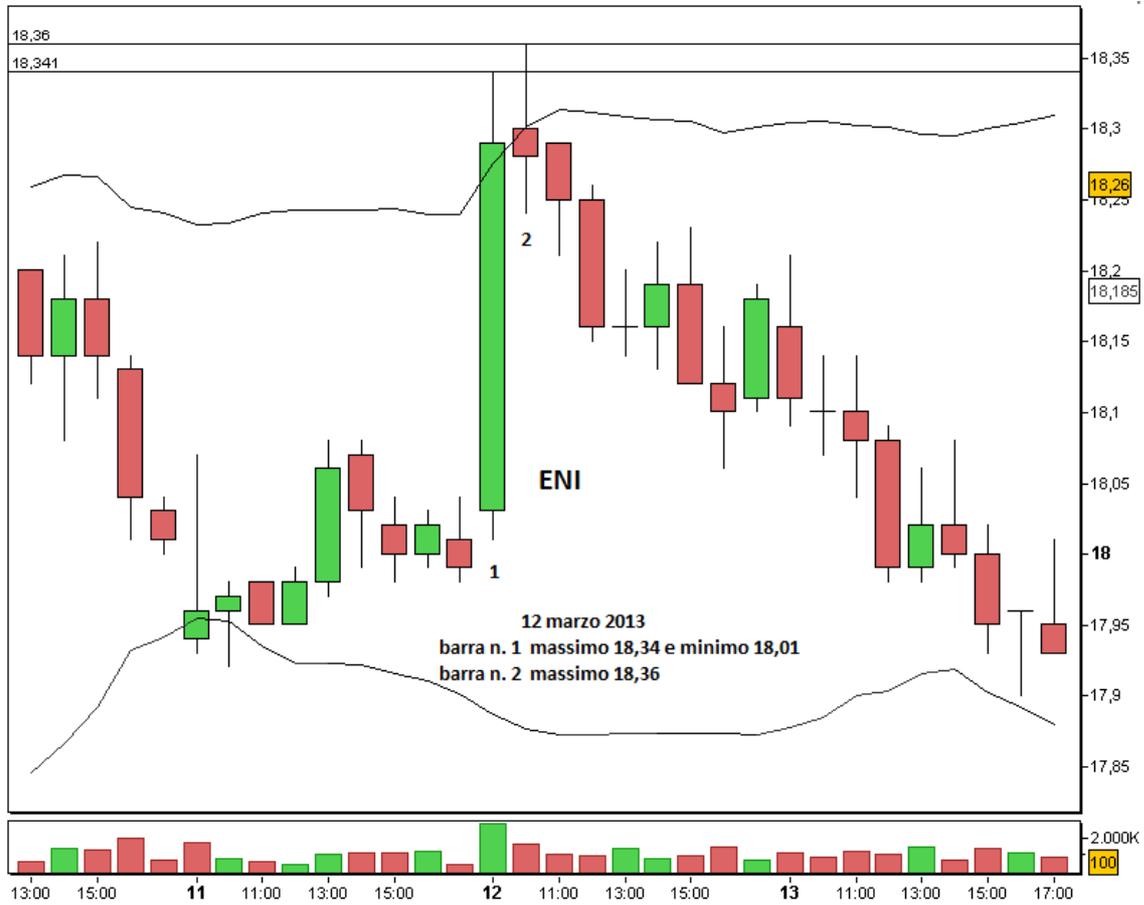
Adesso sta cercando dei fondi per ripartire, ha perso completamente tutti i suoi risparmi e anche tutto il guadagno che aveva accumulato con accuratezza e professionalità.

Il mercato ci mette alla prova tutti i giorni, non è facile trovare il giusto equilibrio per la nostra operatività, dobbiamo lavorarci tutti i giorni. Non dobbiamo mai modificare la nostra strategia operativa, solo con il tempo e la

dedizione giornaliera riusciremo a trovare i giusti equilibri e le giuste contromisure da adottare giornalmente.

Hunter stop

Figura n. 9: Eni, Grafico orario 12 marzo 2013

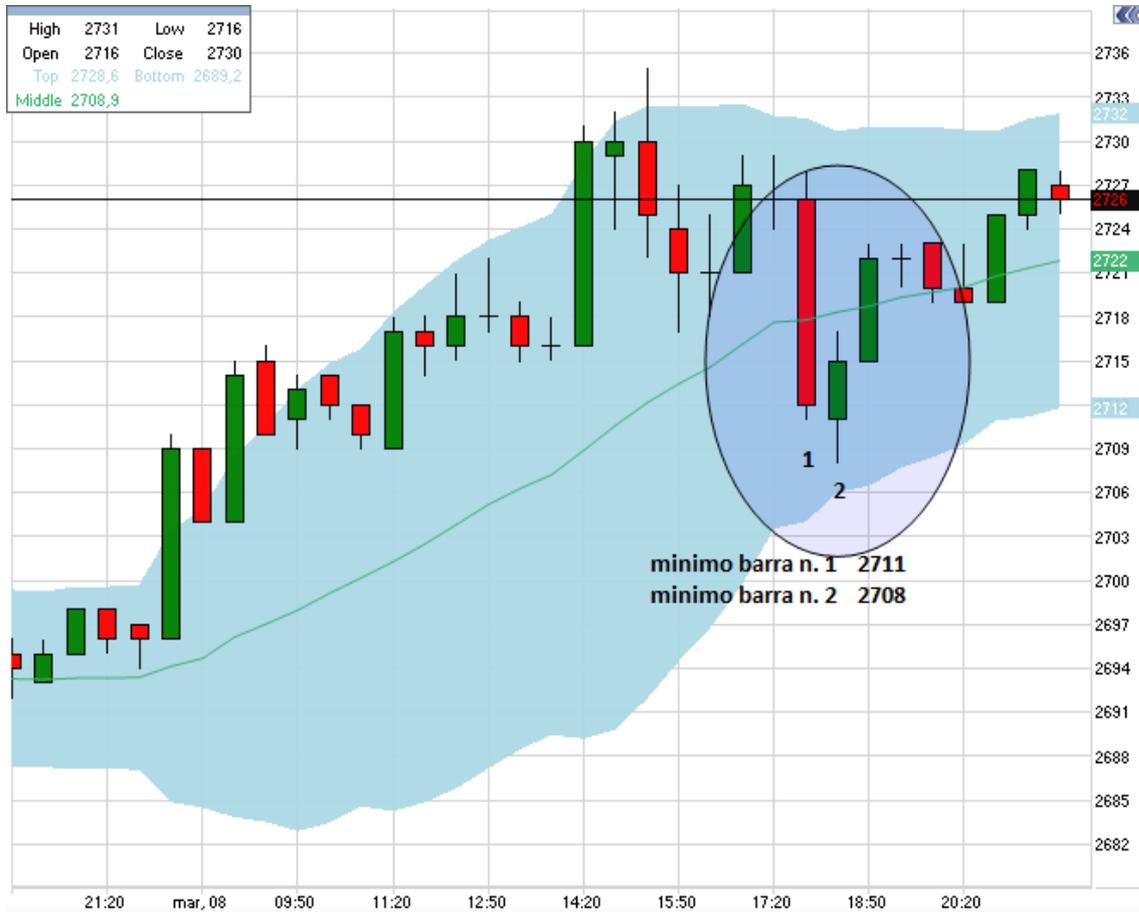


Il grafico è del titolo Eni, la barra numero 1 determina un massimo a 18.34. L'entrata short sarà sulla barra numero 2 una volta che la stessa avrà formato un nuovo massimo a 18,36 e sarà scesa al di sotto del massimo della barra numero 1 di almeno 1 tick. In quel preciso istante a 18,33 si entrerà short con stop collocato 1 tick sopra il nuovo massimo della barra numero 2 (18,37).

Il target dell'operazione può essere gestito in vari modi come riportato nelle pagine dedicate al doppio massimo, oppure direttamente 1 tick sopra il minimo della barra numero 1 (18,02).

Hunter stop

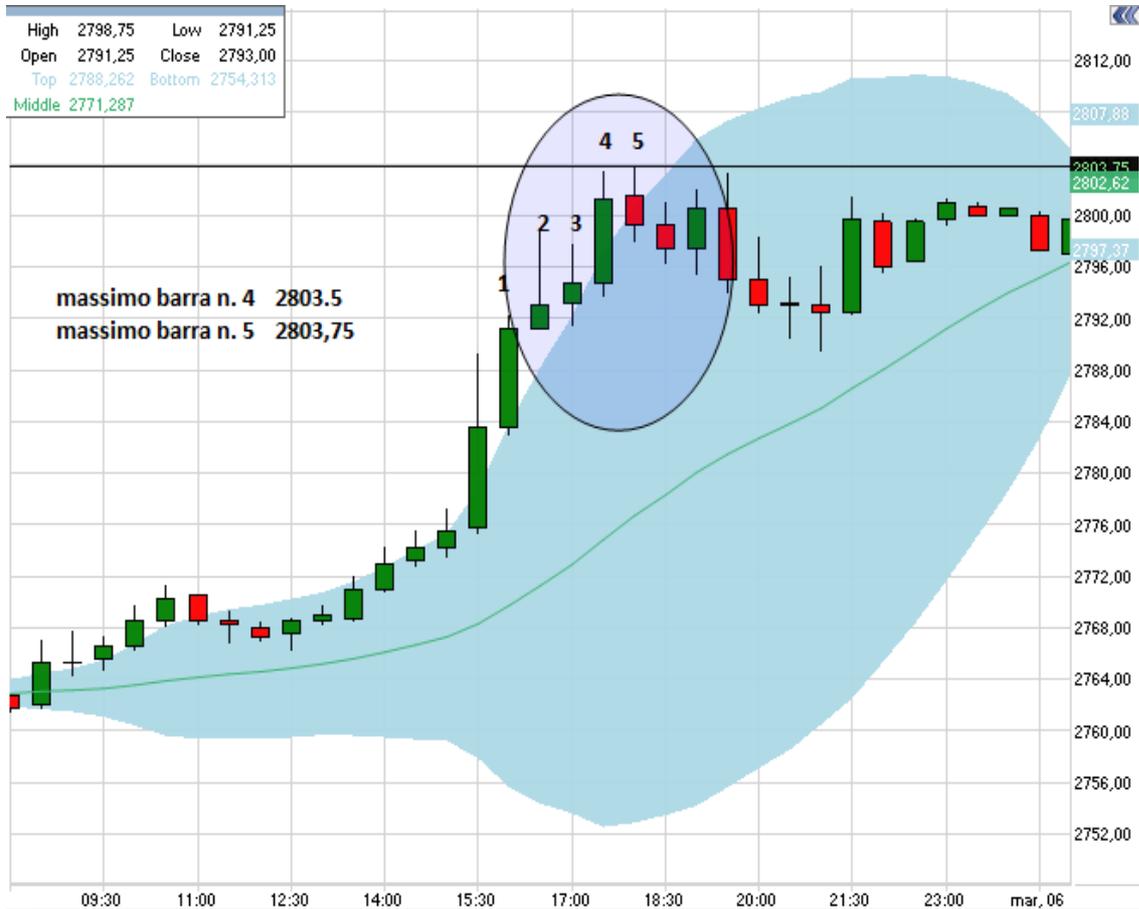
Figura n. 10: Future Euro Stoxx 30 minuti 7 marzo 2013



Siamo lontani ma non di molto dalle bande di Bollinger. La barra numero 1 è la barra timone, una barra molto importante. L'operazione long sarà effettuata nella barra numero 2 una volta che avrà recuperato il minimo della barra numero 1, per cui il nostro ingresso sarà a 2712 con stop a 2707, cioè 1 tick al di sotto della barra numero 2. Anche in questo caso la gestione dell'operazione poteva essere a target o del triplo rispetto al rischio. Nel grafico l'esito sarà a target ma anche nel caso in cui non fosse stato così la perdita sarebbe stata molto contenuta.

Hunter stop

Figura n. 11: Future Mini Nasdaq 30 minuti 5 marzo 2013



In questo grafico del Mini Nasdaq, l'operazione short avviene nella barra numero 5 una volta che la stessa supera il massimo della barra numero 4. Tra il massimo della barra numero 4 e il massimo della barra numero 5 c'è solo 1 tick di differenza. Visto che lo scatto minimo del tick su questo strumento finanziario è di 0,25 l'entrata short sarà a 2803,25 (1 tick sotto il massimo della barra numero 4). Lo stop viene collocato 1 tick sopra il massimo della barra numero 5 (a 2804). Anche in questo caso l'operazione va a target, ed essendo lo stop di 3 tick, possiamo ipotizzare un gain di 9 tick **(RR)**.

Hunter stop

Figura n. 12: Future Mini Nasdaq 30 minuti 22 febbraio 2013



In questo grafico del Mini Nasdaq, l'operazione short avviene nella barra numero 2 una volta che supera il massimo della barra numero 1. Tra il massimo della barra numero 1 e il massimo della barra numero 2 ci sono solo 2 tick di differenza. Lo scatto minimo del tick su questo strumento finanziario è di 0,25, per cui l'entrata short sarà a 2728.75 (1 tick sotto il massimo della barra numero 1). Lo stop sarà collocato 1 tick sopra il massimo della barra numero 2 (a 2729.75). Anche in questo caso l'operazione va a target ed essendo lo stop di 4 tick, possiamo ipotizzare un gain di 12 tick (**RR**) .

Hunter stop

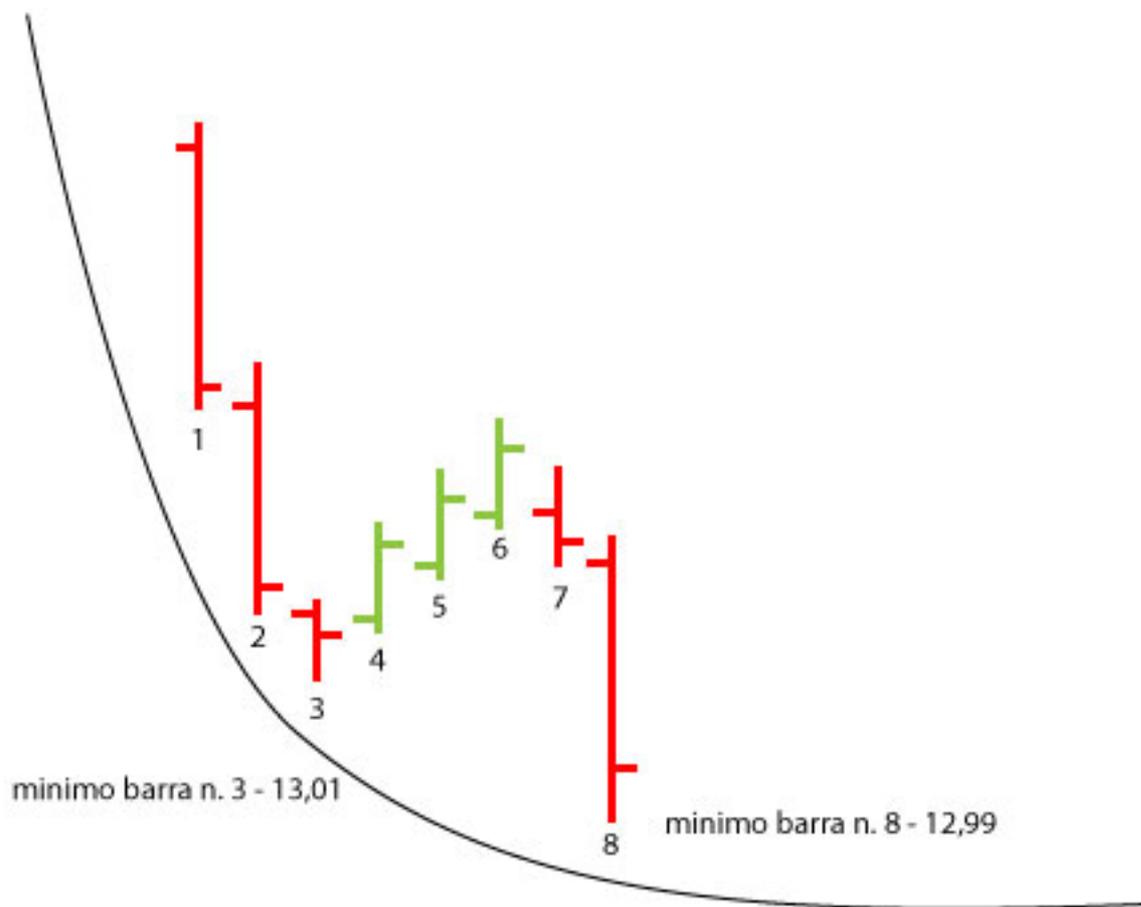
Figura n. 13: Future Euro Stoxx 13 marzo 2013



In questo grafico del Future dell'Euro Stoxx, ci troviamo nella parte inferiore delle bande di Bollinger, l'entrata long avverrà nella barra numero 2 (a 2694) una volta che la stessa avrà recuperato il minimo della barra numero 1. Lo stop sarà collocato a 2691, 1 tick al di sotto del minimo della barra numero 2. Il target può essere collocato 1 tick sotto il massimo della barra numero 1 oppure essendo lo stop di 3 tick, possiamo ipotizzare un gain di 9 tick (**RR**) .

BIG HUNTER STOP

Big Hunter stop sui minimi
Figura n. 1

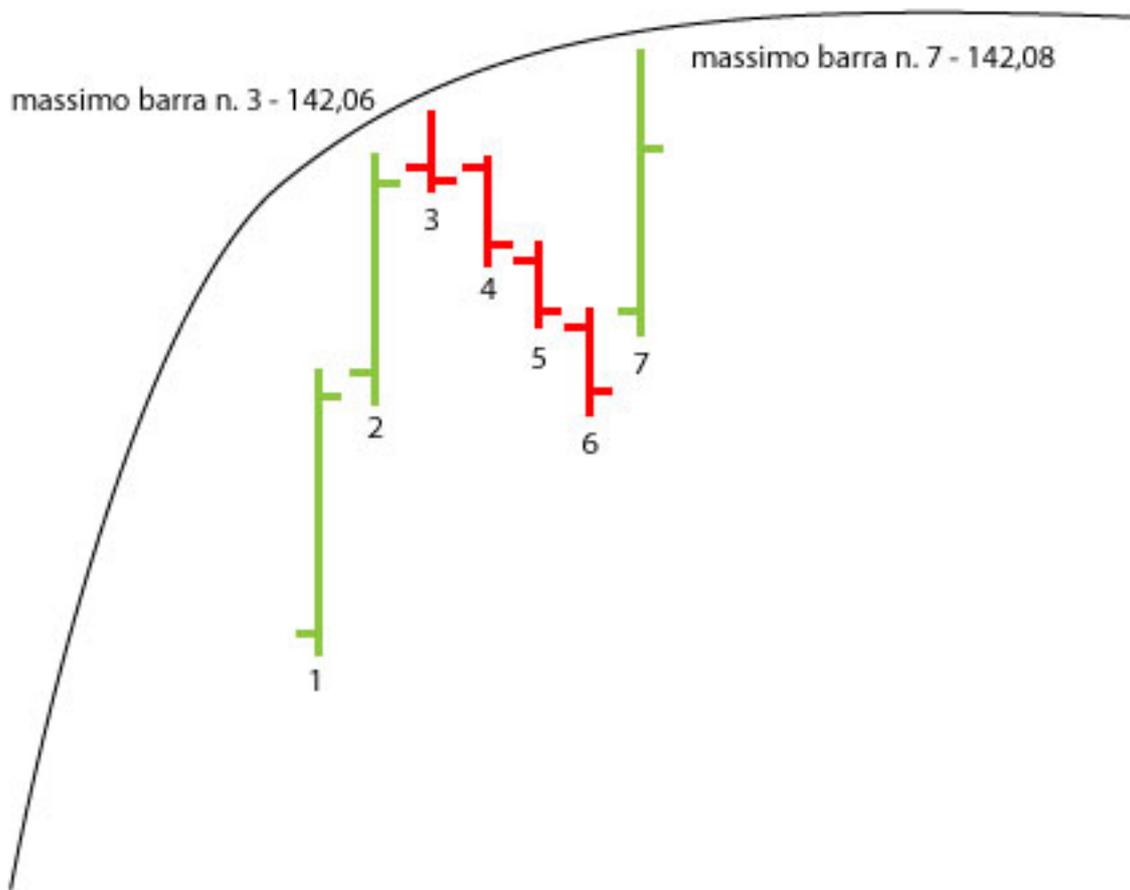


Ci troviamo nella parte inferiore delle bande di Bollinger. L'entrata in buy sarà sulla barra numero 8 dopo che avrà rotto il minimo della barra numero 3. Si entra a mercato con prezzo limite 1 tick sopra il minimo della barra numero 3. Lo stop sarà collocato 1 tick sotto il minimo della barra numero 8. In questo caso perché sia rispettato il rapporto di RR la differenza tra il minimo della barra numero 3 e il minimo della barra numero 8 non deve essere superiore a 3 tick con uno stop che non deve superare i 5 tick.

Facendo un esempio in termini di calcolo entro a 13,02. Lo stop è posizionato a 12,98 1 tick sotto il minimo della barra numero 8. Il target, perché sia rispettato il rapporto di RR, deve essere di 12 tick visto che lo stop è di 4 tick. Se il minimo della barra numero 8 fosse stato a 12,97 o superiore non avrei aperto l'operazione poiché oltre alla differenza di 5 tick (tra 13,02 e 12,97), sarebbero stati da aggiungere altri 2 tick: 1 dell'entrata a 13,02 e 1 per lo stop a 12,96.

[Clicca su questo link per vedere la Video-spiegazione di Paolo Serafini del grafico](#)

Big Hunter stop sui massimi
Figura n. 2



Ci troviamo nella parte superiore delle bande di Bollinger. L'entrata in sell sarà sulla barra numero 7 dopo che avrà rotto il massimo della barra numero 3. Si vende con prezzo limite 1 tick sotto il massimo della barra numero 3. Lo stop sarà collocato 1 tick sopra il massimo della barra numero 7. Essendo il massimo della barra numero 7 a 142,08 l'entrata short sarà a 142,05. Lo stop sarà collocato a 142,09. La differenza tra il massimo della barra numero 7 e il massimo della barra numero 3 non deve essere superiore a 3 tick per essere conforme alla strategia. Il target sarà gestito come nelle precedenti operazioni per cui con rischio di 4 tick, il target sarà di 12 tick di gain. Se il massimo della barra numero 7 fosse stato a 142,10 o superiore non sarei entrato al recupero del massimo della barra numero 3 essendo lo stop superiore a 5 tick.

[Clicca su questo link per vedere la Video-spiegazione di Paolo Serafini del grafico](#)

Big Hunter stop

Figura n.3: Future mini S&P500 4 marzo 2013



Questo grafico a 30 minuti è del future sul Mini S&P500. Nella barra numero 1 abbiamo un minimo a 1507,5 l'entrata long sarà nella barra numero 2. Dopo circa 2 ore i cacciatori di stop cercano di trascinare il titolo al ribasso per far scattare gli stop a tutti coloro che erano entrati a ridosso della barra numero 1. Il future non accelera al ribasso e il minimo della barra numero 2 non è molto distante dal minimo della barra numero 1. Entro quindi al recupero del minimo della barra numero 1 a 1507,75. Lo stop previsto è di 4 tick, 1 tick sotto il minimo della barra numero 2 a 1506,75. Il target che sarà raggiunto nel corso della giornata sarà di 12 tick.

Big hunter stop

Figura n. 4: Future Mini S&P500 25 febbraio 2013

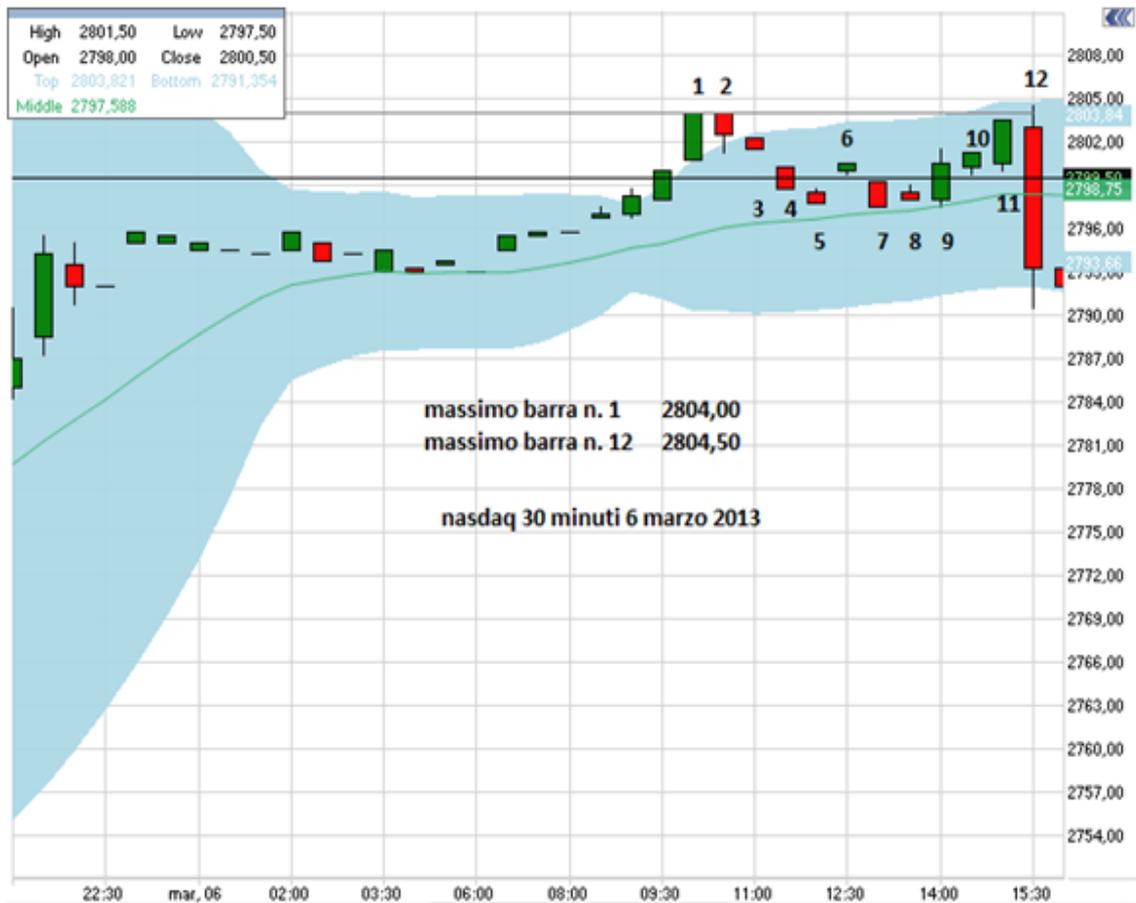


In questo grafico del future sul Mini S&P500 la barra numero 1 forma un massimo a 1523,5 mentre la barra numero 4 forma un massimo a 1524,5. In questo caso l'entrata short sarebbe potuta avvenire nella barra numero 4 a 1523.25. Lo stop sarebbe stato da collocare sopra il massimo della barra numero 4 a 1,52475. Questo stop di 6 tick tradisce in maniera inesorabile la strategia operativa che prevede come stop massimo 5 tick. Pur essendo un'operazione molto profittevole, non rientrando nel piano di trading non l'avrei mai presa in considerazione.

La disciplina nel trading è fondamentale: bisogna attenersi in maniera scrupolosa alla strategia operativa pianificata precedentemente. Se saremo bravi ad applicare in maniera disciplinata tutte le nostre strategie operative potremo raccogliere i frutti del nostro lavoro.

Big hunter stop

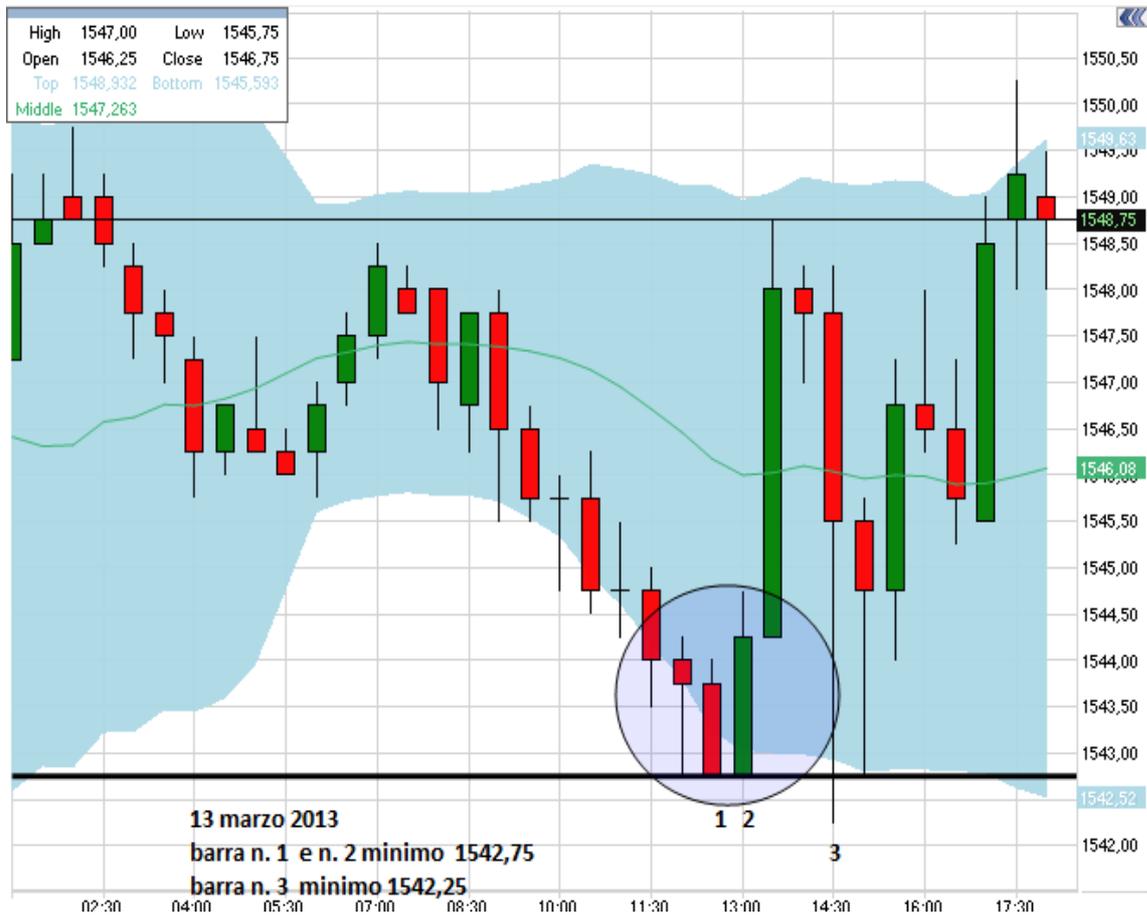
Figura n. 5: Future Mini Nasdaq 6 marzo 2013



Questo grafico a 30 minuti è del future sul Mini Nasdaq. Nella barra 1 abbiamo un massimo a 2804. Dopo qualche ora i market mover (nella barra numero 12) provano a rompere il massimo della barra numero 1 cercando di far scattare gli stop. L'entrata viene quindi effettuata nella barra numero 12 con stop sopra il massimo della stessa. Entro a 2803,75 con stop a 2804,75. Considerando che lo scatto minimo del tick è di 0.25, ho solo 4 tick di stop. L'operazione è coerente con l'investimento essendo uno stop inferiore a 5 tick. L'operazione si chiuderà con un gain di 12 tick come da strategia operativa **RR**.

Big hunter stop

Figura n. 6: Mini S&P500 13 marzo 2013

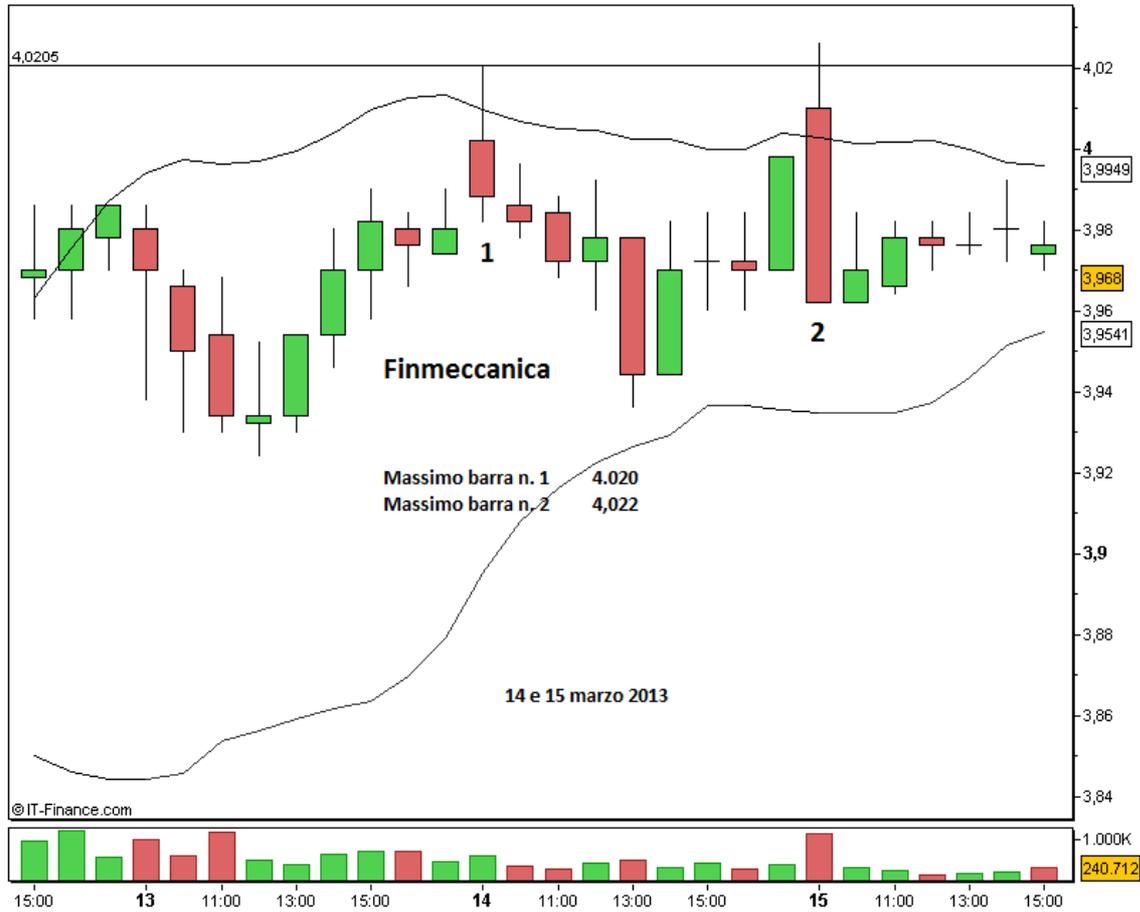


Questo grafico a 30 minuti è del future sul Mini S&P500. La barra numero 3 accelera violentemente al ribasso rompendo il minimo del giorno (posizionato nella barra 1 e 2). La distanza tra i minimi della barra 1 e 2 e il nuovo minimo della barra numero 3 è inferiore a 5 tick per cui lo stop loss è coerente con la strategia operativa. Entrerò quindi long nella barra numero 3 al recupero del doppio minimo delle barre 1 e 2 (a 1543). Lo stop sarà posizionato sotto il nuovo minimo della barra numero 3 a 1542.

Il lavoro dei large trader è stato eseguito perfettamente facendo scattare lo stop loss di coloro che erano lunghi sopra il livello di doppio minimo. Il titolo va a target realizzando 12 tick di gain a fronte di una perdita massima di 4 tick.

Big hunter stop

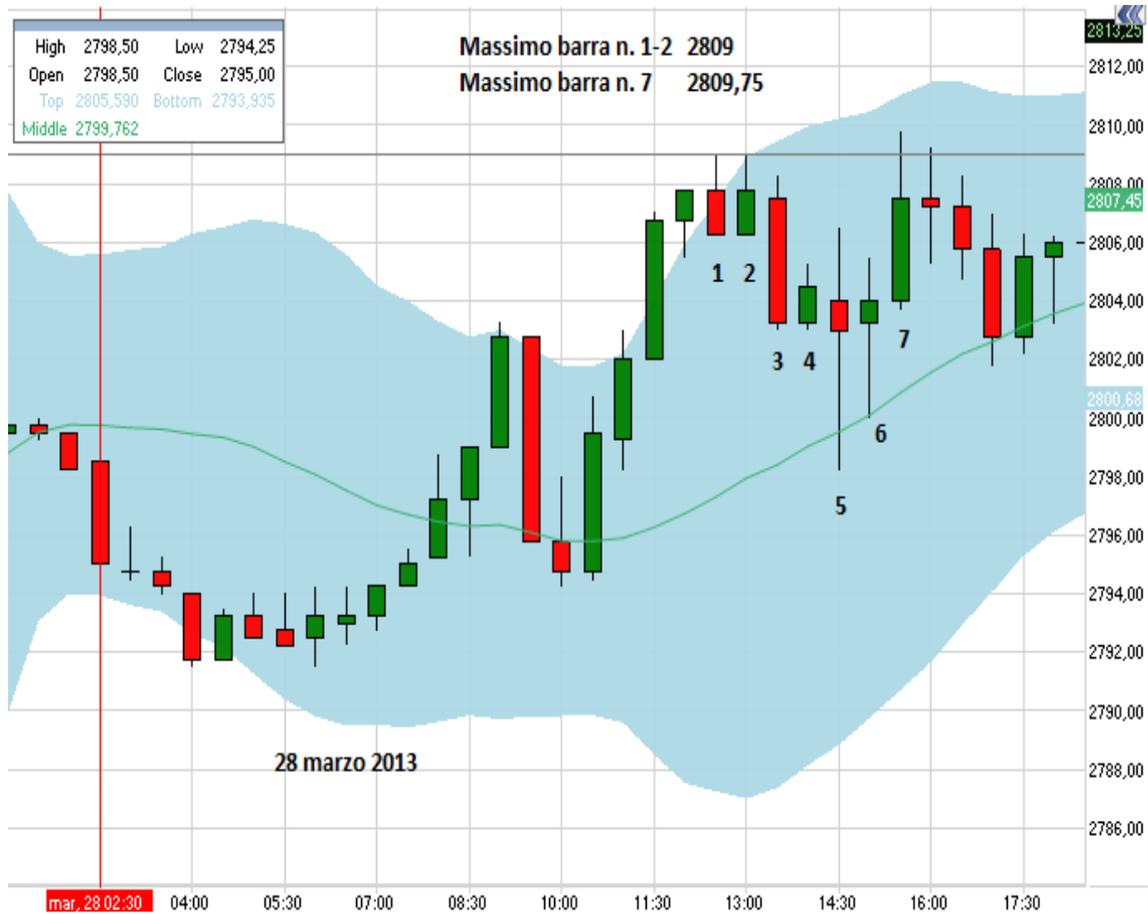
Figura n. 7: Finmeccanica 14 e 15 marzo 2013



Il grafico è del titolo Finmeccanica, il time frame è orario. Il titolo ha realizzato un primo massimo il 14 marzo e il 15 un altro massimo superiore al primo di un solo tick. Dato che lo scatto minimo del tick su questo strumento finanziario è di 0.002, l'entrata short sarà nella barra numero 2 una volta che avrà recuperato il massimo della barra numero 1 (a 4,018). Lo stop sarà posizionato 1 tick sopra la barra numero 2 a 4,024. Con lo stop di 4 tick il rendimento dovrà essere di 12 tick. Il **RR** andrà a target nella barra numero 2.

Big hunter stop

Figura n. 8: Future Mini Nasdaq 28 marzo 2013

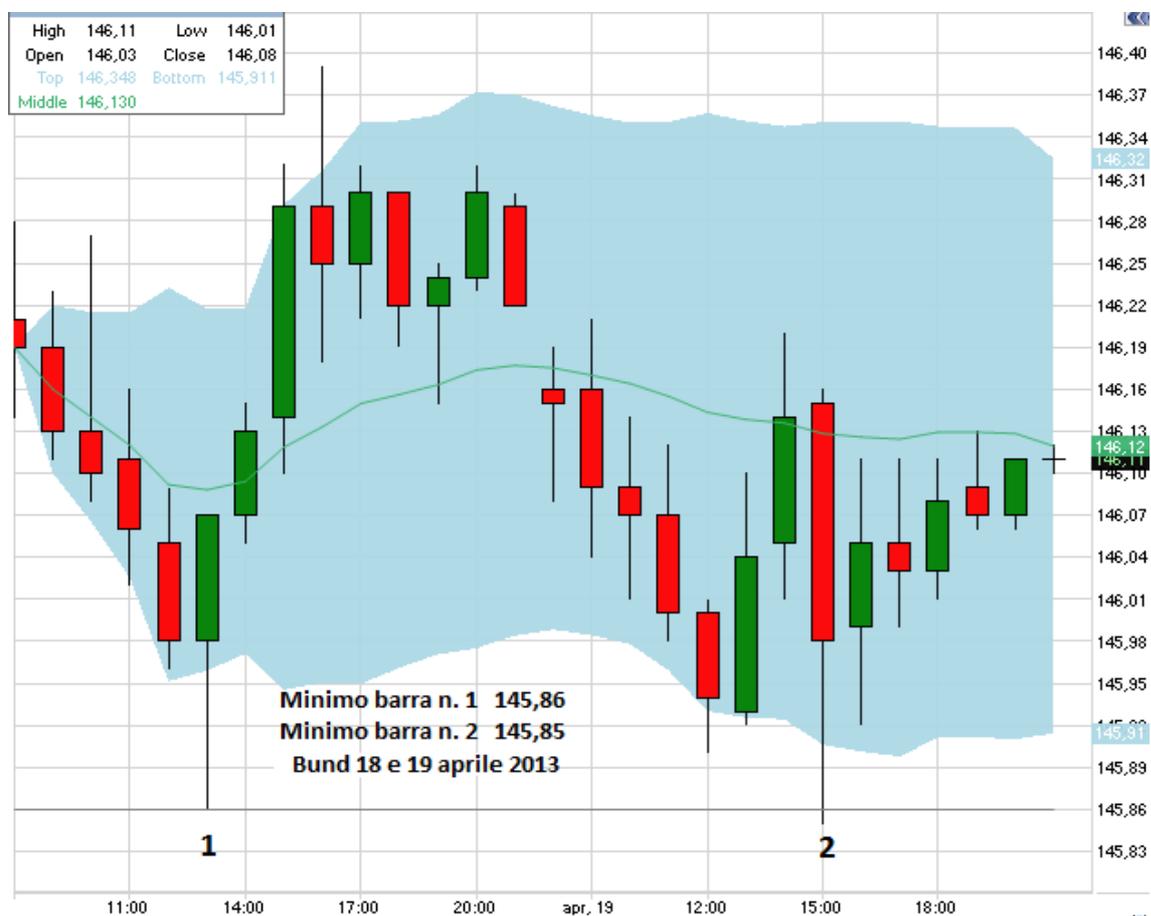


Il grafico che analizziamo ora riguarda il Future del Mini Nasdaq e ha time frame a 30 minuti. Le barre numero 1 e numero 2 formano un doppio massimo a 2809 mentre la barra numero 7 forma un massimo a 2809,75. In questo caso l'entrata short dovrebbe avvenire nella barra numero 7 a 2808,75 con stop sopra il massimo della barra numero 7 a 2810. Lo stop è di 5 tick, ed è perfettamente coerente con la strategia operativa. Il target in questo caso sarà di 15 tick, quindi il **RR** è perfettamente coerente con l'investimento scelto.

Anche in questo caso con l'apertura del mercato statunitense i market mover hanno cercato in tutti i modi di far scattare gli stop appena sopra la barra del doppio massimo giornaliero. Una volta eseguito il movimento desiderato, riportano velocemente il mercato verso il basso con 4 barre negative.

Big hunter stop

Figura n. 9: Future Bund 18-19 aprile 2013



Questo grafico orario è del Future del Bund del 18 e 19 aprile 2013. Il 18 aprile si forma un minimo a 145,86. Il giorno successivo, dopo diversi movimenti al rialzo e al ribasso, il Future accelera fortemente a ridosso del minimo del giorno precedente. Naturalmente i market mover tenteranno di rompere quel minimo sia per far scattare gli stop di chi si era posizionato long il giorno precedente sia per far scattare qualche ordine short ai ribassisti. Il movimento funziona perfettamente e una volta colpito lo stop il Future del Bund recupera quel minimo. L'entrata long sarà quindi posizionata 1 tick al di sopra del minimo della barra numero 2 (a 145,87) con stop sotto il nuovo minimo della barra numero 2 (a 145,84). La posizione viene gestita come nelle precedenti operazioni, e va ampiamente a target come si può notare dalle barre successive.

Big hunter stop

Figura n. 10: Future Oro 22 e 25 marzo 2013



Per concludere riporto il grafico con time frame a 30 minuti dell'Oro, sperando che sia di buon auspicio a tutti i trader. In questo caso l'operazione non doveva assolutamente essere aperta poiché lo stop tra il recupero del minimo della barra numero 2 e il minimo della barra numero 1 era troppo ampio. Infatti il minimo della barra numero 1 era a 1602,6 e il minimo della barra numero 2 era a 1601,5. L'entrata long sarebbe dovuta scattare a 1602,7 con stop a 1601,4 quindi con 13 tick di stop. L'operazione non sarebbe stata conforme con nessuna delle strategie operative affrontate in questo libro.

ANALISI DI ALCUNE FIGURE GRAFICHE PARICOLARI

Figura n. 5

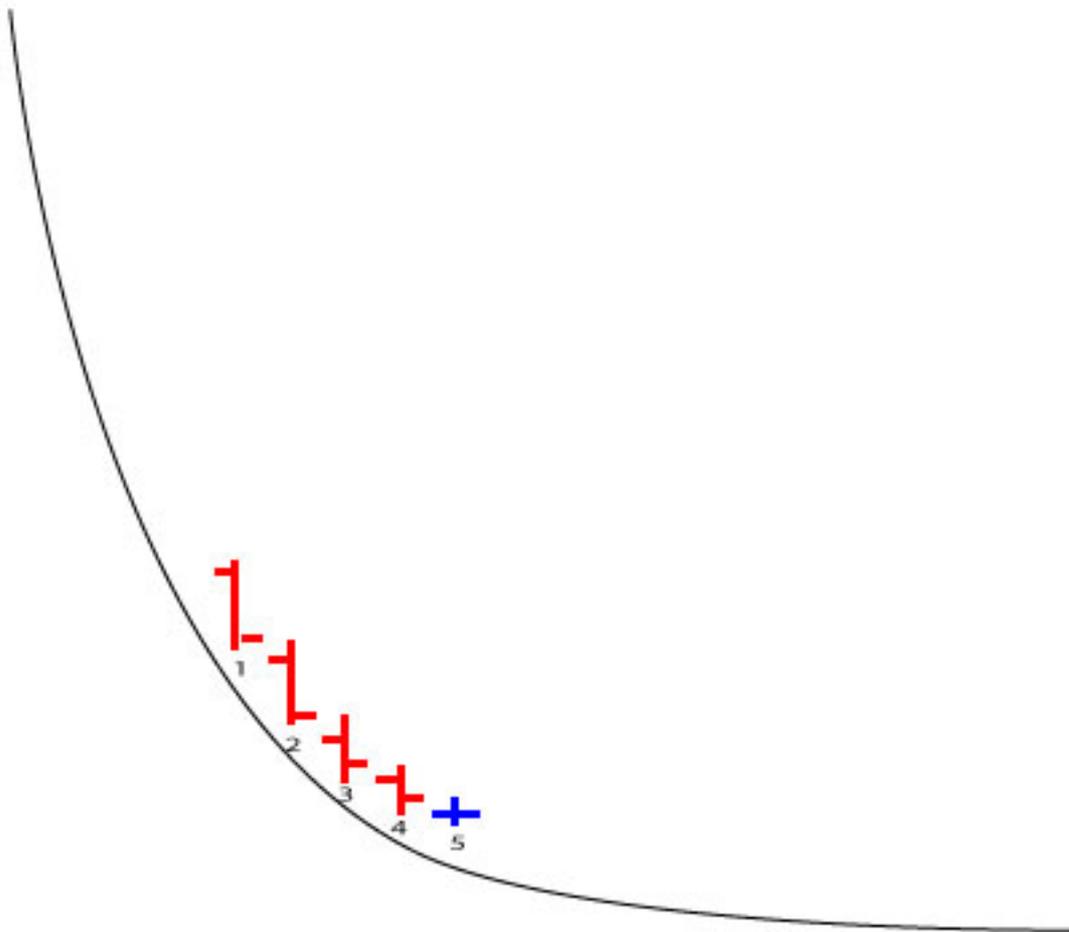
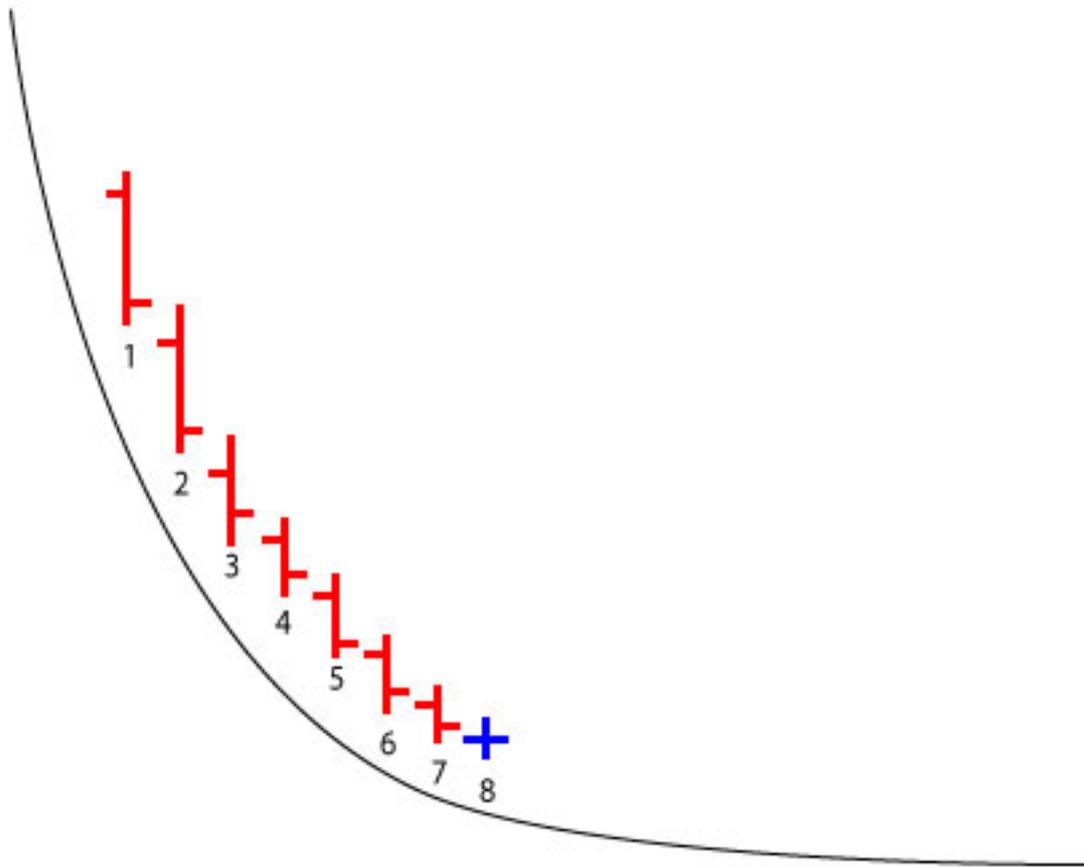


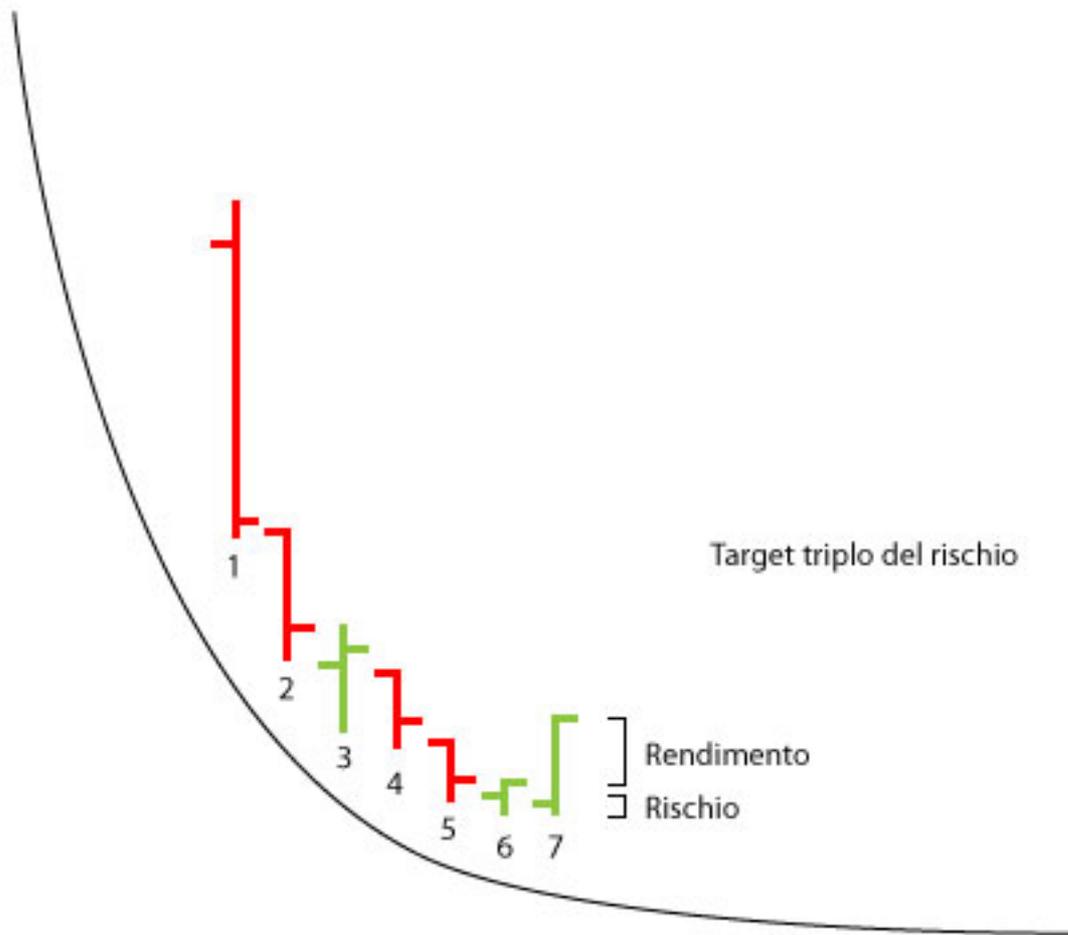
Figura n. 6



I grafici qui riportati sono già stati analizzati durante la spiegazione del doppio minimo o doppio massimo. In casi simili a quelli di queste figure l'entrata non va fatta sul doppio minimo, vista la tendenza in atto estremamente ribassista. Solitamente in questi casi si dovrebbe aspettare una qualsiasi rottura di una barra precedente.

[Clicca su questo link per vedere la Video-spiegazione di Paolo Serafini del grafico](#)

Figura n. 7

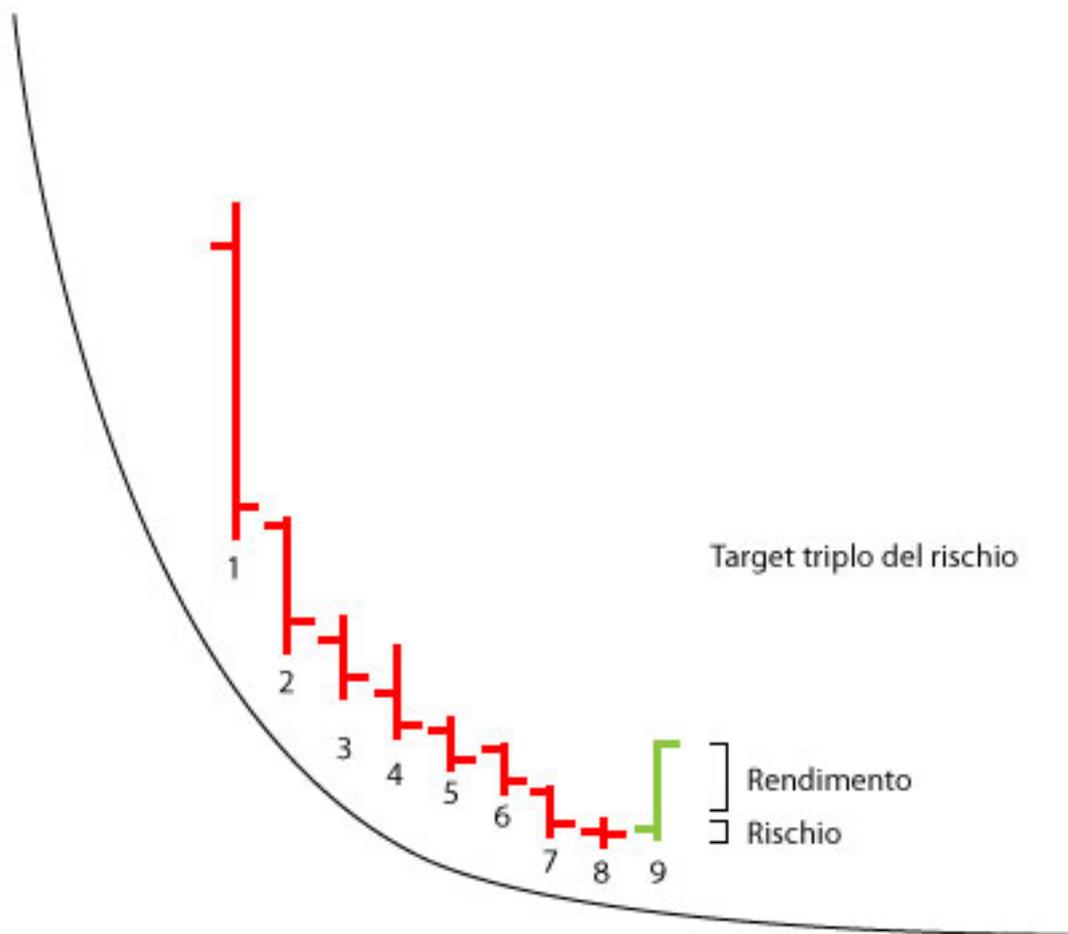


Come si può notare in questo grafico, entrerà nella barra numero 7 una volta che avrà superato la barra numero 6. Lo stop sarà collocato sotto il minimo della barra numero 7. Si potrebbe anche posizionare lo stop al di sotto del doppio minimo poiché in questo caso lo stop sarebbe di soli 5 tick rientrando perfettamente nella strategia operativa già discussa nel libro come stop massimo per ogni singola operazione.

Per quanto riguarda il target sarà gestito in maniera dinamica, senza tralasciare che come primo target devo considerare un valore almeno del triplo rispetto allo stop. Solo con questo sistema e con queste entrate riuscirò nel tempo ad ottenere dei risultati veramente significativi.

[Clicca su questo link per vedere la Video-spiegazione di Paolo Serafini del grafico](#)

Figura n. 8



In questo grafico l'entrata sarà simile all'entrata del grafico precedente. Entrerò al formarsi della barra numero 9, una volta che avrà rotto il massimo della barra numero 8. Lo stop ed il target saranno gestiti come nell'operazione precedente. La stessa considerazione andrebbe fatta se ci trovassimo nella parte alta delle bande di Bollinger. In quel caso le entrate sarebbero ovviamente in modalità short e sarebbero eseguite solo in caso di rottura al ribasso di una barra tenendo sempre in considerazione che tra la rottura e il nostro stop non devono mai esserci più di 5 tick di perdita.

Siamo giunti al termine della parte riguardante la descrizione e analisi dei vari pattern da me utilizzati.

Quelli che prediligo individuare sono sicuramente l'hunter stop e il big hunter stop su time frame a 30 minuti o superiori.

Nel caso in cui il grafico da me analizzato raggiunga livelli interessanti di rottura di massimi o minimi importanti concentro la mia attenzione nell'individuazione di un calicetto. Trattandosi spesso di un cambio di direzionalità del mercato risulta essere molto profittevole.

Per quanto riguarda il primo pattern grafico analizzato, riguardante il doppio minimo e il doppio massimo, è necessario prestare maggiore attenzione ed eventualmente allargare leggermente lo stop loss rispetto ad altri pattern. A causa dell'interferenza dei market mover i livelli grafici potrebbero non essere rispettati completamente rendendo meno visibili queste importanti figure dell'analisi grafica.

Un'ulteriore accorgimento da utilizzare per ottimizzare l'operatività è quello di entrare a mercato solo nel caso in cui non ci sia molta volatilità. Nel caso non si conosca adeguatamente lo strumento finanziario analizzato sarà sufficiente passare al grafico con time frame a 1 minuto. In questo modo si potrà desumere la velocità degli scambi e si potrà decidere se è possibile intraprendere operazioni su time frame superiori non rischiando che lo stop stretto venga colpito.

La pratica costante ci permetterà di avere una maggiore conoscenza dello strumento finanziario analizzato e ci aiuterà a capire quando la velocità sarà normale o elevata.

L'entrata a mercato dovrà avvenire solo nel caso in cui siano individuate figure grafiche che corrispondano esattamente

alla strategia di trading utilizzata.

In ogni caso vi consiglio, soprattutto per chi è alle prime armi, di non intraprendere ulteriori operazioni dopo che siano stati colpiti due stop consecutivi nel corso della stessa giornata di trading. Nel caso di giornate negative consecutive vi consiglio invece di fermarvi e riprendere l'operatività in demo fino a quando non si torni a guadagnare costantemente.

Un altro particolare da non dimenticare riguarda gli orari di negoziazione. In orari con poca liquidità è meglio astenersi dall'operare e aspettare momenti con liquidità maggiore con volumi considerevoli. In questi casi le figure rendono al meglio e sono maggiormente profittevoli.

Un grandissimo in bocca al lupo a tutti e buon proseguimento di lettura.

Nel terzo volume del manuale del trader idiota andremo ad evidenziare l'importanza della disciplina.

Max W. Soldini e Gaspare ti insegneranno come crearti le ancore per non cadere nei più stupidi errori che il trader perdente commette.

Potrai acquisire la capacità e gestire l'emotività quando operi in reale con denaro vero.

