

CORSO DI TRADING: LIVELLO AVANZATO



LEGGENDO QUESTO CORSO, IMPARERAI:

- Analisi matematica
- Indicatori di tendenza e loro tipi
- Sistemi di trading
- Segnali di trading
- Diario di trading



INDICATORI DI TENDENZA E LORO TIPI

ANALISI MATEMATICA (INDICATORI TECNICI)

INTRODUZIONE ALL'ANALISI MATEMATICA (INDICATORI TECNICI)

Gli indicatori tecnici sono strumenti che eseguono determinati calcoli in base a determinate formule costruite sugli indicatori del grafico del prezzo e del volume di trading, producendo automaticamente un risultato. Questi indicatori vengono utilizzati nella piattaforma di trading InstaTrader.

Gli indicatori di tendenza sono progettati per determinare la tendenza. L'efficacia degli indicatori di tendenza aumenta quando si forma una nuova tendenza di mercato. Gli indicatori di tendenza sono costruiti direttamente sul grafico e si muovono parallelamente al prezzo. Inoltre, gli indicatori possono periodicamente bloccare il prezzo e cambiare la loro posizione.

Ecco i principali indicatori di tendenza:

- Moving Average - Media mobile (MA);
- Average Directional Movement Index (ADX)

MOVING AVERAGE

La media mobile è un indicatore di tendenza standard che mostra il valore medio del prezzo per un certo periodo di tempo. La media mobile mostra la futura direzione del trend e la tendenza del prezzo ascendente o discendente.

Il prezzo di uno strumento di trading per un dato periodo viene mediato per il calcolo di questo indicatore. Ad esempio, il periodo da 10 mostra le ultime dieci candele utilizzate per tracciare una media mobile. Nel timeframe H1, ci sono 10 candele orarie. Informazioni più dettagliate sulle formule sono fornite nel manuale della piattaforma di trading che si apre premendo F1.

Esiste una tendenza: più ampio è il periodo, più levigata è la media mobile. E viceversa, più stretto è il periodo, più acuta è la media mobile.

Ci sono tre medie mobili nell'immagine sottostante: MA rossa - periodo 10; MA gialla - periodo 35; MA blu - periodo 70.

Si prega di prestare attenzione che la MA rossa (la più veloce perché il periodo è il più stretto) si avvicina al grafico del prezzo e copia quasi ogni fluttuazione del prezzo. Allo stesso tempo la MA



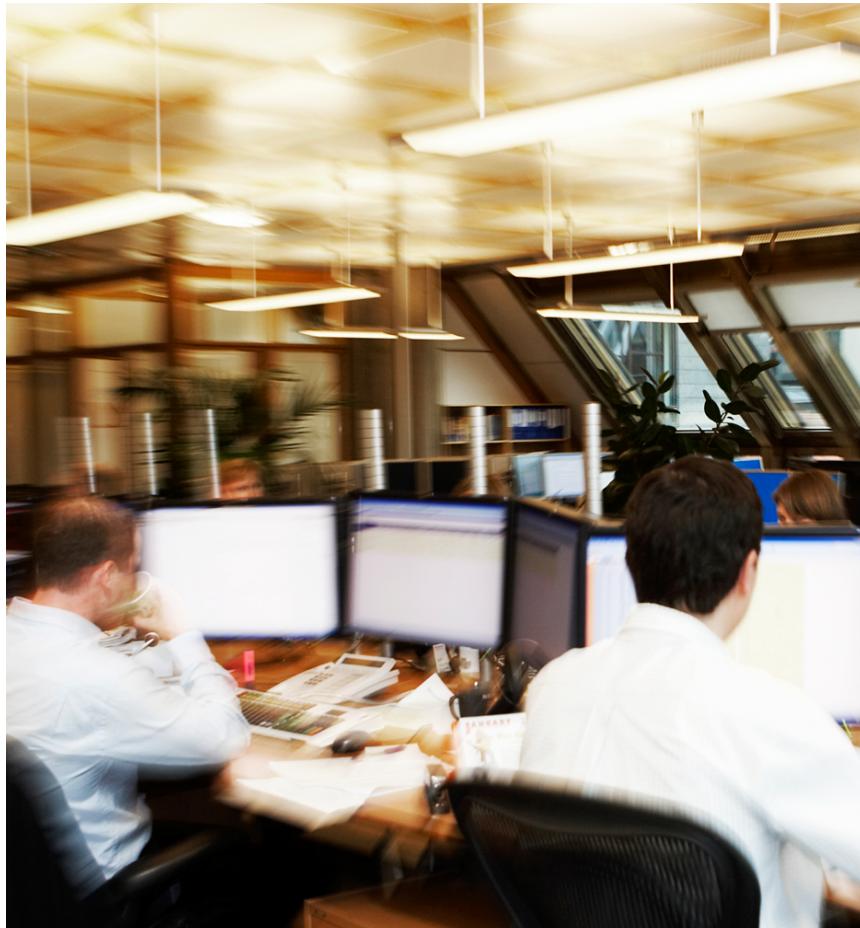
blu (la più lenta perché il periodo è il più ampio) si sta allontanando dal grafico del prezzo e risponde a malapena ai movimenti correttivi. La MA indica solo la direzione della tendenza sottostante.

Esistono diversi tipi di medie mobili:

- Simple Moving Average(SMA) - Media mobile semplice
- Exponential Moving Average(EMA) - Media mobile esponenziale
- Smoothed Moving Average (SMMA) - Media mobile levigata
- Linear Weighted Moving Average (LWMA) - Media mobile ponderata lineare

I principi del trading per ciascuno di questi tipi di medie mobili sono gli stessi. L'unica differenza sta nel metodo di calcolo della media mobile.

L'indicatore della media mobile è uno strumento piuttosto importante che è spesso un componente di altri indicatori tecnici.



Come interpretare i segnali MA?

Se la linea della MA è diretta verso l'alto, allora funge da un segnale di acquisto, mentre se la MA è diretta verso il basso, funge un segnale di vendita.

Come applicare una media mobile su un grafico

Il principio di trading con una media mobile è davvero semplice: è necessario tracciare due MA con un periodo stretto e uno ampio e osservare i momenti in cui si incrociano.

Per esempio:



Se la MA veloce (con il periodo da 10 rappresentato in verde) interseca la MA con un periodo più ampio (rappresentato in rosso) dal basso verso l'alto, viene aperto un ordine Buy. Se la MA veloce (10) interseca la MA (30) dall'alto verso il basso, viene aperto un ordine Sell. In realtà, i periodi migliori e generici delle medie mobili non esistono. Ogni trader applica i periodi (10, 20, 30, 40, ecc.) che si adattano meglio al suo scopo di trading. Esiste un metodo effettivo: i trader applicano due MA (ad esempio, con periodi da 5 e 10) ad un grafico e guardano come si comportano. Se genereranno troppi segnali falsi, i periodi vengono aumentati di 5 unità, vale a dire 10 e 15 si applicano invece di 5 e 10 di conseguenza. In questo modo i trader cercano di impostare i parametri dell'indicatore più adatti.



AVERAGE DIRECTIONAL INDEX (ADX)

L'indice direzionale medio è stato creato da Welles Wilder, che ne ha parlato nel suo libro del 1978 New Concepts in Technical Trading Systems.

ADX si concentra sulla misurazione della forza o della debolezza di una tendenza, ma può anche aiutare a determinare la sua direzione. L'indice aiuta a stabilire se c'è una tendenza nel mercato e quanto è forte.

L'Average Directional Index ha 3 linee:

- Linea ADX.
- Indicatore direzionale positivo (+DI) che indica una tendenza ascendente
- Indicatore direzionale negativo (-DI) che indica una tendenza discendente

Nella tabella sottostante la linea principale di ADX è mostrata insieme alle linee +DI e -DI.



La linea ADX misura la forza di una tendenza. Una linea ascendente significa che la tendenza sta guadagnando forza. Una linea discendente mostra una tendenza che sta perdendo slancio o si sta invertendo. Una linea piatta indica il consolidamento. È importante ricordare che la linea ADX non fornisce alcuna informazione sulla direzione del trend. Quando la linea ADX sale, può segnalare tendenze sia rialziste che ribassiste.

Le altre due linee consentono di determinare la direzione del trend. Quando si sviluppa un trend rialzista, +DI è maggiore di -DI. Per una tendenza discendente, -DI è maggiore di +DI.

Sebbene le letture ADX si trovino nell'intervallo da 0 a 100 pip, raramente raggiungono un minimo o un massimo. Il valore ADX inferiore a 20 indica un trend debole (consolidamento Forex), un valore superiore a 40 indica un trend forte in sviluppo.

Quando c'è una chiara tendenza del mercato - rialzista o ribassista - la distanza tra le linee DI cresce così come le letture ADX. Al contrario, quando l'attività di mercato è bassa, si riducono sia la distanza tra le linee DI che la lettura ADX.

ADX mostra le migliori prestazioni dopo i periodi di consolidamento, ma può fornire falsi segnali dopo le inversioni di mercato a forma di V.

Come applicare ADX su un grafico

I segnali di acquisto si formano quando la linea +DI è sopra la linea -DI e la linea ADX cresce. Lo stop loss dovrebbe essere fissato al di sotto del prezzo minimo recente.



I segnali di vendita si formano quando la linea +DI è al di sotto della linea -DI mentre la linea ADX è in crescita. Il livello di stop loss deve essere impostato al di sopra del prezzo massimo recente.



OSCILLATORI

L'oscillatore ha preso il nome dal lat. oscillo. In effetti, l'oscillatore è un sistema che oscilla (su e giù) con una certa periodicità. Gli oscillatori sono riferiti agli indicatori principali. Gli indicatori principali forniscono informazioni su un ciclo economico imminente o un cambiamento di una tendenza del mercato.

Nell'analisi tecnica, gli oscillatori sono un'espressione matematica del tasso di prezzo nel tempo. Esternamente, gli oscillatori nell'analisi tecnica sembrano sinusoidi, oscillogrammi o cardiogrammi.

Gli aspetti chiave che dovrebbero essere presi in considerazione quando si applicano gli oscillatori sono le condizioni di mercato ipercomprato e ipervenduto. Quando il mercato è ipercomprato il prezzo si trova vicino al limite superiore ed è improbabile che cresca ulteriormente. Quando il mercato è ipervenduto il prezzo è al suo livello più basso ed è improbabile che scenda ulteriormente. È meglio analizzare e utilizzare gli oscillatori quando il mercato è stabile, ma essi possono anche mostrare il momento di inversione della tendenza.

Ecco gli oscillatori più popolari:

- Istogramma MACD;
- Momentum;
- Velocità di cambiamento del prezzo (ROC);
- Indice di forza relativa (RSI);
- Oscillatore stocastico (Stochastics).

Diamo un'occhiata dettagliata a questi indicatori.



INDICATORE MACD

MACD è un acronimo di Moving Average Convergence Divergence ovvero indica quando le medie mobili convergono o divergono. È un indicatore di tendenza che mostra la relazione tra due medie mobili dei prezzi.

MACD



L'indicatore è costituito da tre componenti: linea MACD, linea del segnale, istogramma.

- La linea MACD è la differenza tra una media mobile esponenziale lenta (EMA) e una EMA veloce. Per impostazione predefinita, questi dati nelle impostazioni dell'indicatore sono impostati come 12 e 26 (l'EMA veloce e lenta, rispettivamente). Per tracciare la linea MACD, l'EMA lenta (26) viene sottratta dall'EMA veloce (12).
- La linea del segnale è la media mobile esponenziale (EMA) dalla linea MACD.
- L'istogramma MACD è un'interazione visiva semplificata della linea MACD e della linea del segnale. L'istogramma mostra la differenza tra la linea MACD e la linea del segnale. Più la linea MACD devia verso l'alto dalla linea del segnale, più alte saranno le colonne dell'istogramma. Al contrario, minore è la distanza tra la linea MACD e la linea del segnale, più basse saranno le colonne.

È importante sottolineare che nessun indicatore può fornire segnali sempre chiari, quindi i trader esperti di solito combinano vari strumenti tecnici nelle loro strategie.

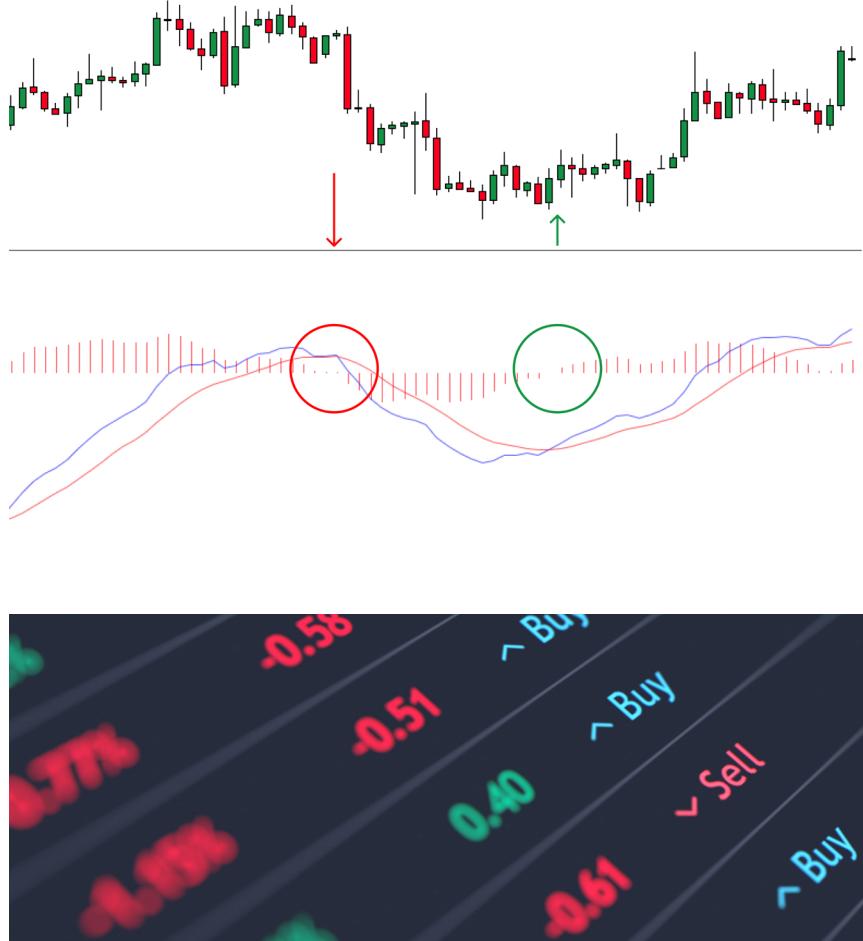
Come applicare MACD su un grafico

I segnali primari si formano quando un istogramma attraversa una linea dello zero. Se l'istogramma MACD attraversa una linea mobile dal basso verso l'alto, viene generato un segnale di acquisto.

Se l'istogramma attraversa una MA dall'alto verso il basso, viene generato un segnale di vendita.

La forza di tali segnali dipende dai movimenti precedenti dell'istogramma. Se la MACD è rimasta sospesa sopra la linea dello zero per troppo tempo, ma poi ha iniziato a calare e l'istogramma ha attraversato la linea dello zero dall'alto verso il basso, allora dovrebbe essere considerato come un forte segnale di vendita. Un segnale di acquisto viene interpretato in modo inverso. Nota che tutti gli indicatori, non importa quanto siano buoni, possono fornire e forniranno falsi segnali di volta in volta. Si consiglia, quindi, di ricontrollare i segnali ricevuti con altri indicatori o timeframe diversi.

MACD



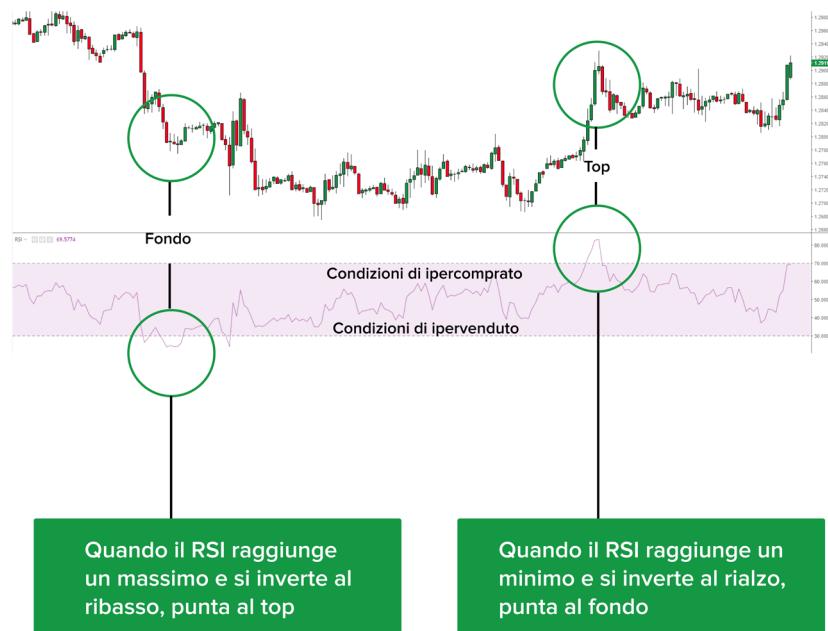
INDICE DI FORZA RELATIVA (RSI)

Il Relative Strength Index (RSI), sviluppato da J. Welles Wilder, è un oscillatore di momentum che stima la velocità e il cambiamento dei movimenti del prezzo. Il RSI oscilla tra zero e 100. Tradizionalmente, il RSI è considerato ipercomprato quando è superiore a 70 e ipervenduto quando è inferiore a 30. È possibile generare segnali cercando divergenze e oscillazioni di fallimento. Il RSI può anche essere utilizzato per identificare la tendenza generale.

Come applicare RSI su un grafico

Interpretazione tipica dei livelli di ipercomprato e ipervenduto. Il modo comune di considerare gli oscillatori e le loro aree di ipercomprato e ipervenduto è pensare a loro come un segnale per fare trading nella direzione opposta. Come suggerisce il nome, quando il mercato è ipercomprato, l'acquisto è eccessivo e possiamo aspettare che il prezzo effettui una correzione discendente o un'inversione. D'altra parte il mercato ipervenduto segnala una possibile crescita del prezzo.

RSI



TECNICHE DI TRADING. COME EVITARE ERRORI COMUNI

Sistema di trading

Un sistema di trading è un toolkit di regole e decisioni (sia commerciali che analitiche), basato su segnali di trading e strumenti di analisi di mercato.

Qualsiasi sistema di trading dovrebbe rispondere alle seguenti domande:

- Cosa sta succedendo nel mercato adesso?
- Cosa può succedere ora?
- Cosa dovrebbe fare un trader ora?



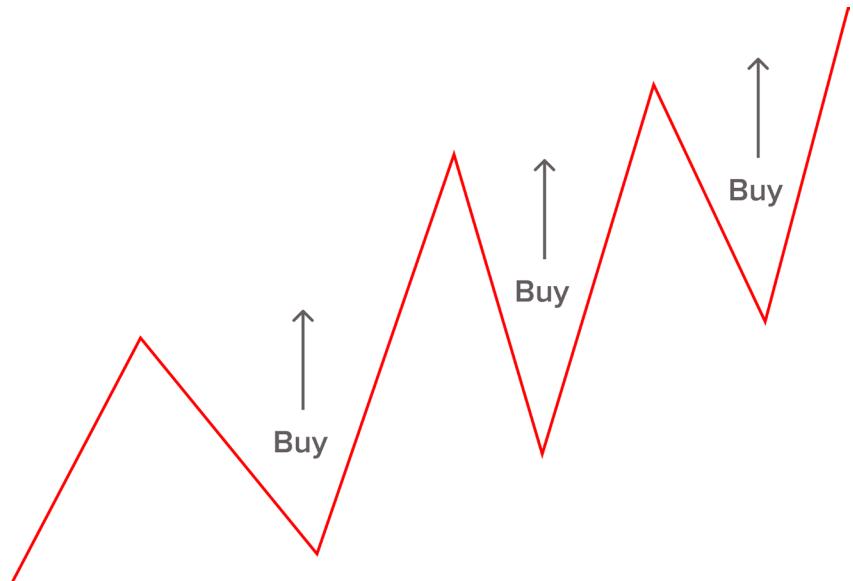
TIPI DI SISTEMI DI TRADING

Sistemi di trading che seguono una tendenza.

Tali sistemi attendono un certo movimento del prezzo e poi danno un segnale per aprire una posizione nella stessa direzione, partendo dal presupposto che il trend continuerà per qualche tempo.

I sistemi impiegano ampiamente strumenti lineari, pattern di analisi tecnica, indicatori di tendenza e oscillatori. Di norma, le operazioni vengono eseguite dopo un ritracciamento nel mercato.





Pro:

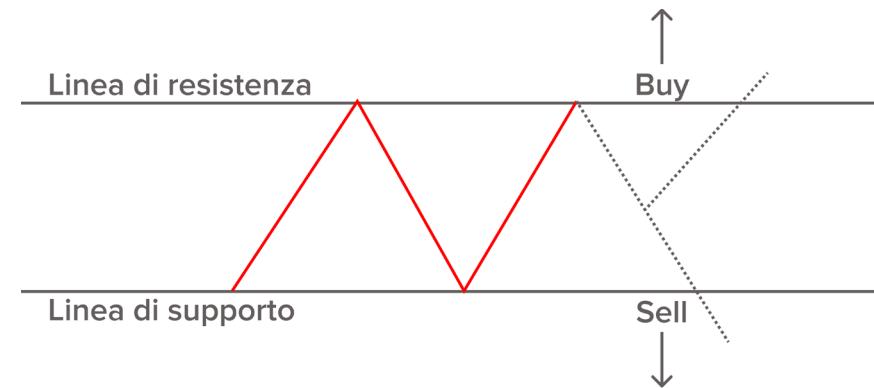
- una vasta gamma di profitti;
- stop loss nelle vicinanze;
- possibilità di aumentare i volumi di posizioni aperte.

Contro:

- Quando le condizioni di mercato non sono chiare, tali sistemi di trading possono generare molti falsi segnali.

FARE TRADING QUANDO VENGONO ROTTI I LIVELLI DI SUPPORTO O RESISTENZA.

Il messaggio centrale di questo sistema è semplice. La capacità del mercato di raggiungere un nuovo massimo o minimo indica la possibilità che il trend prosegua nella direzione della rottura.



Pro: un tale sistema di trading fornisce segnali chiari su una nuova tendenza. Inoltre, indica quando la tendenza potrebbe terminare.

Contro: i problemi principali di tali sistemi di trading sono false rotture dei livelli di supporto e resistenza, soprattutto in mercati altamente volatili.

SISTEMI DI TRADING, OPERANTI NELL'INTERVALLO DI TRADING.

Questa strategia è fare trading in un mercato flat, quando il prezzo oscilla tra determinati livelli, cioè all'interno di un intervallo. I trader che utilizzano questa strategia trovano i livelli chiave di supporto e resistenza con l'aiuto dell'analisi tecnica.

Successivamente, acquistano ai livelli di supporto inferiori e vendono nella zona di resistenza.

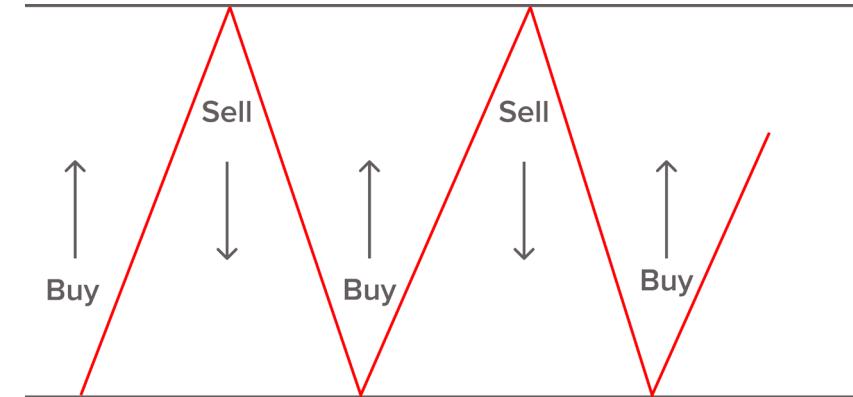
Tali sistemi di trading comunemente impiegano oscillatori che hanno le zone di ipercomprato e ipervenduto, ad esempio un oscillatore stocastico.

Pro:

- Questo sistema di trading consente ai trader di guadagnare in tali condizioni di mercato, ossia quando la maggior parte dei partecipanti al mercato subisce perdite.

Contro:

- È difficile decidere tempestivamente quando il mercato flat finirà.
- Un trader perde la maggior parte della Price Action seguendo una tendenza.



Combinazione di strategie di trading

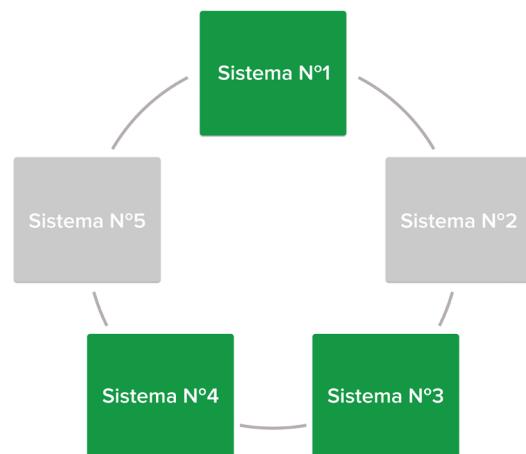
La maggior parte dei trader professionisti non concentra la propria attenzione su una strategia di trading. Applicano una combinazione di tutte e tre le strategie di trading che consente loro di ottenere profitti in qualsiasi condizione di mercato.

Un fattore di grande importanza per valutare la qualità di un sistema di trading è la sua semplicità.

Le cose semplici sono sempre le migliori. Il sistema di trading dovrebbe rispettare pienamente questo principio.

La strategia dovrebbe includere:

- 1.** Fondamento logico. È l'idea principale alla base della strategia di trading. È il fondamento su cui si basano tutti gli altri componenti;
- 2.** Strumenti di trading;
3. Timeframe e tempo di trading (sessione di negoziazione);
- 4.** Regole di entrata (segnali per aprire una posizione);
- 5.** Regole di uscita. Come vengono impostati lo stop loss e il take profit (ad esempio, dove impostare i livelli di stop loss e take profit);
- 6.** Il volume delle negoziazioni e la gestione del rischio.



INDICATORI DI ANALISI TECNICA

Molti trader che ottengono profitti costanti sul Forex devono il loro successo all'analisi tecnica. È importante sottolineare che l'analisi tecnica deve essere accurata e giustificata. Può essere effettuata tramite tutti gli strumenti disponibili su una piattaforma di trading. Tuttavia, i trader principianti hanno difficoltà a combinare e scegliere gli strumenti tecnici appropriati. Ma con pazienza e impegno chiunque può imparare a fare un'analisi efficiente e completa.

Ecco un esempio di come un trader può applicare gli indicatori tecnici.

Ad esempio, supponiamo che il grafico a candele GBP/USD mostri un calo correttivo all'interno del trend rialzista prevalente. Un trader deve decidere dove aprire una posizione Buy.

A tale scopo, lui traccia alcuni livelli di supporto e resistenza, cercando possibili punti pivot. Vediamo il prezzo presumibilmente trovare un punto pivot a 1,5648. Quindi, il trader applica un altro strumento tecnico, i livelli di Fibonacci, che lo aiuta a scoprire dove si trova il prezzo in questo momento e se

c'è un punto pivot. Il trader vede che al momento Fibo 50,0% interseca il livello di supporto, confermando così la probabilità di un punto pivot. Il passo successivo è analizzare gli indicatori tecnici, in particolare l'oscillatore stocastico che è l'equivalente al suddetto indicatore RSI. Il principio è lo stesso: identificare le zone di ipercomprato e ipervenduto. Il valore dello Stocastico superiore a 80 segnala condizioni di ipercomprato mentre il valore inferiore a 20 indica condizioni di ipervenduto. Nel nostro caso, lo Stocastico è inferiore a 20. Quindi, questo è già un terzo segnale di acquisto. La Divergenza rialzista fornisce un segnale decisivo finale. Questo pattern di candela indica che è possibile un'inversione di tendenza verso l'alto se la candela corrente si sovrappone al 100% al corpo della candela precedente.

Tracciamo una conclusione. Tutti gli strumenti tecnici applicati in questo esempio evidenziano la stessa idea di trading, ovvero acquistare. Abbiamo presentato un'analisi complessa. Sta a te scegliere un particolare kit di strumenti tecnici.



SEGNALI DI TRADING

Quali segnali particolari degli indicatori o altri strumenti dovrebbero essere tenuti in considerazione facendo trading? Dipende dagli strumenti da te scelti in quanto ognuno genera i propri segnali e interagisce con altri indicatori tecnici, fornendo così un risultato netto.

Ad esempio, esaminiamo Triple Screen, un popolare sistema di trading di Alexander Elder. Il nostro obiettivo è capire come vengono generati i segnali.



SISTEMA DI TRADING TRIPLE SCREEN (A TRIPLO SCHERMO)

Alexander Elder ha introdotto la strategia Triple Screen nel 1986 e da allora è diventata popolare. È utilizzata fino ad oggi da molti trader in una variazione o nell'altra.

L'idea di base del sistema Triple Screen è quella di effettuare un triplo controllo delle transazioni: in una delle fasi verranno eliminate molte posizioni possibili. Identifichiamo i trend di lungo, medio e breve termine ed entriamo nel mercato solo nella direzione del trend prevalente.



INDICATORI

La strategia Triple Screen utilizza una combinazione di oscillatori e indicatori di tendenza.

La gamma di indicatori che possono essere utilizzati non è limitata. È importante determinare la tendenza su un ampio timeframe utilizzando l'indicatore di tendenza e trovare un punto di entrata utilizzando l'oscillatore. Pertanto, si può utilizzare qualsiasi oscillatore e indicatore di tendenza.

Questo sistema di trading si basa su tre schermi o tre timeframe: grafici a 4 ore, 1 ora e 15 minuti.

La prima schermata ci consente di individuare una tendenza. Quindi, possiamo decidere in quale direzione aprire una posizione. A tal fine, possiamo utilizzare un oscillatore MACD. Se le barre MACD sono inclinate al rialzo, ciò indica una tendenza ascendente, e di conseguenza, le barre al ribasso indicano una tendenza discendente.

Per identificare direzione di una tendenza



Il passo successivo è il secondo grafico.

Qui cerchiamo il punto di entrata nel mercato più adatto. Potrebbe essere un ritracciamento minore o una correzione. In questa fase, il nostro compito è valutare se c'è un ritracciamento o una correzione. Dovremmo valutare un punto preciso. Supponiamo di aver visto un ritracciamento minore. Dobbiamo scoprire il grado di correzione e se il mercato è in condizioni di ipervenduto. Questo compito viene risolto tramite un oscillatore stocastico. Vediamo l'oscillatore stocastico scendere al di sotto del livello di ipervenduto (20%) e procedere verso l'alto. Questo segnale significa che il ritracciamento è terminato e il precedente segnale di acquisto è stato confermato.

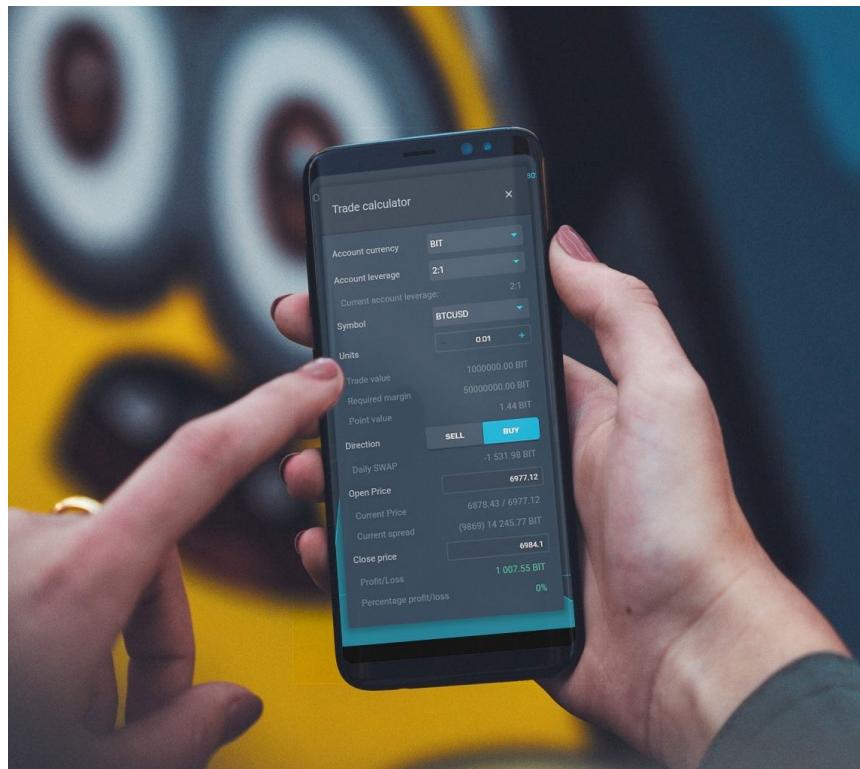


Momento per entrare nel mercato

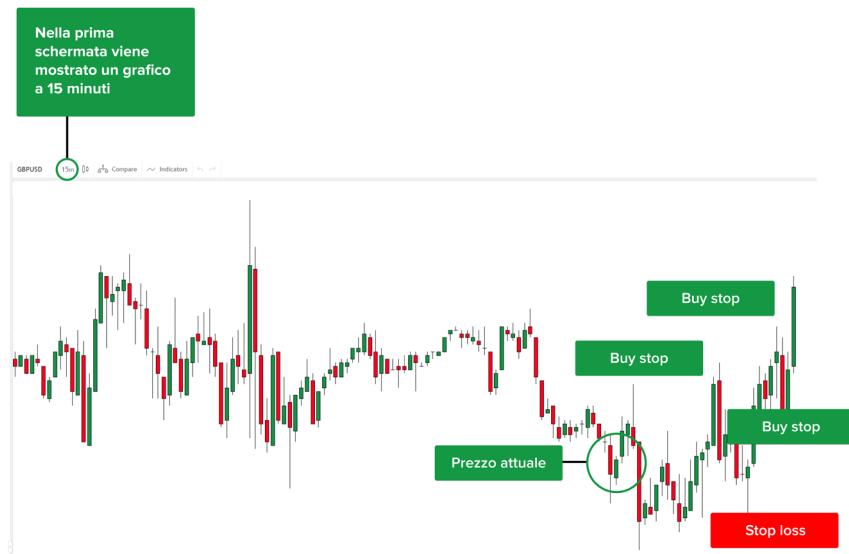


Alla fine, proseguiamo con la terza schermata che ci darà un'idea per un punto di entrata nel mercato.

Su questo grafico, impostiamo un ordine in sospeso o un buy stop che è un paio di pip sopra il massimo della candela corrente (riportato sul grafico)



Entrata nel mercato



È importante sottolineare che se il buy stop non viene attivato quando si forma la candela successiva, questo ordine deve essere spostato al massimo della candela successiva con il valore più basso. Questa è la candela giusta dove trasferiamo il nostro buy stop. Se l'ordine viene attivato correttamente, dovremmo impostare lo stop loss. Dovrebbe essere impostato un paio di pip sotto il prezzo più basso delle ultime due candele.

CONCLUSIONE

Il sistema Triple Screen di Alexander Elder può essere un'ottima base per costruire la strategia di trading Forex. La cosa principale è controllare le transazioni in più fasi, seguendo solo una tendenza a lungo termine.



DIARIO DI TRADING

Le qualità essenziali dei trader sul forex sono l'autocontrollo e la capacità di gestire le proprie emozioni. In condizioni di mercato difficili, quando le emozioni prendono il sopravvento, ogni principiante e forse anche alcuni trader esperti cadono vittime delle loro decisioni di trading affrettate e poco sagge. Come mantenere la calma e sviluppare l'autodisciplina? Un'ottima soluzione è tenere un diario di trading. Puoi tenere traccia di ogni tuo passo sul Forex che può aiutarti a risolvere la tua routine di trading quotidiana. Assicurati di includere informazioni dettagliate su ogni operazione e, soprattutto, sul motivo per aprire o chiudere l'operazione in una tabella speciale. Ecco un esempio di tale tabella.



coppia	volume	posizione	data	convinzione	strategia utilizzata	ricompensa per rischio	punti	redditizio o meno
EUR/USD	1	lunga	12/07/20	alta	triple screen	2	200	+
USD/JPY	2	corta	14/07/20	media	RSI	2	150	-
CAD/JPY	1	lunga	15/07/20	alta	MACD	3	80	+
EUR/USD	0,5	lunga	16/07/20	alta	intuizione	1	50	+
USD/JPY	2	lunga	17/07/20	bassa	MA	2	150	+

Ogni trader ha il proprio modo per tenere un diario. Tuttavia, la qualità dei record ha un impatto diretto sui risultati del trading. Se un trader si prefigge l'obiettivo di sbarazzarsi delle emozioni e degli errori di trading, il diario deve essere considerato parte integrante della routine. Quando i segnali di trading sono stati analizzati e registrati in forma scritta, la mente umana funziona in modo più efficiente, quindi il trader è in grado di effettuare analisi più approfondite e individuare errori.

Oltre alle annotazioni regolari e accurate di ogni operazione, è altrettanto importante rivedere le decisioni di trading per un determinato periodo. Soprattutto, l'analisi delle singole decisioni di trading aiuta a scoprire i propri errori, a rendersi conto delle ragioni dietro di essi e a mettere a punto le tecniche di trading.

Per riassumere, ecco cosa hai imparato dopo aver letto questo corso:

1. Gli indicatori tecnici sono strumenti che eseguono determinati calcoli in base a determinate formule costruite sugli indicatori del grafico del prezzo e del volume di trading, producendo automaticamente un risultato.
2. Un oscillatore è un sistema che oscilla (su e giù) con una certa periodicità nel tempo.
3. Un sistema di trading è un toolkit di regole e decisioni (sia di trading che analitiche), basato sui segnali di trading e strumenti di analisi di mercato.
4. Il sistema Triple Screen utilizza più indicatori come mezzo per filtrare segnali di trading contraddittori.



Avvertenza sui rischi: I CFD sono strumenti complessi e presentano un rischio significativo di perdere denaro rapidamente a causa della leva finanziaria. 73,78% di conti di investitori al dettaglio che perdono denaro a causa delle negoziazioni in CFD con questo fornitore. Valuti se comprende il funzionamento dei CFD e se può permettersi di correre questo alto rischio di perdere il Suo denaro.

Disclaimer:

Queste informazioni sono fornite ai clienti al dettaglio e professionisti come parte della comunicazione di marketing. Non contiene e non deve essere interpretata come contenente consigli di investimento o raccomandazioni di investimento o un'offerta o una sollecitazione a impegnarsi in qualsiasi transazione o strategia in strumenti finanziari. Le performance passate non sono una garanzia o una previsione delle performance future. Instant Trading EU Ltd. non rilascia alcuna dichiarazione e non si assume alcuna responsabilità in merito all'accuratezza o completezza delle informazioni fornite, o qualsiasi perdita derivante da qualsiasi investimento basato su analisi, previsioni o altre informazioni fornite da un dipendente della Società o altri.