

New Trading Moving

Un nuovo modo di tradare i movimenti della Borsa utilizzando gli STEP cioè i LIVELLI
di **Alfredo Riccardi**

Dopo vari anni di studio dell'analisi tecnica tradizionale e dell'analisi tecnica che segue cicli, ho pensato di sviluppare una tecnica basata essenzialmente sullo studio dei numeri espressi dal mercato, che meglio si adattava al mio modo di operare, che non è di trend-follower bensì di trade di breve e medio-breve, con l'esigenza quindi di tradare anche i trend secondari del mercato, e le relative inversioni di breve che avvengono quasi quotidianamente sui mercati utilizzabili sia da chi può seguire costantemente sul monitor, sia da chi ha invece qualche ora o anche meno di tempo per potere inserire ordini e relativi stop e take profit.

I grafici sono degli strumenti interpretabili sia per individuare dei pattern, di cui non nego ovviamente la validità, delle figure, dei channel, Tline e quant'altro, ma possono essere soprattutto utilizzati, con questa tecnica, per ricavarne delle proiezioni numeriche (vedi ad es i numeri di Fibonacci, Gann etc.).

In pratica il grafico rappresenta ciò che è già successo e da questo si cerca di capire basandosi sui numeri:

1. Qual'è il trend di breve (per i derivati è determinante avere piccoli scarti di tolleranza per non avere stop onerosi).
2. Qual'è il trend di medio-breve.
3. Quali sono le condizioni, cioè i valori, che devono essere rispettati per il mantenimento dei trend sia di breve sia di medio breve o che invece ne decretino le inversioni.
4. Quali sono i target possibili.
5. Attraverso l'utilizzo di questi livelli che non sono oro colato ma lucida analisi sui numeri, si ha dei punti chiari di riferimento sia nei momenti di lieve volatilità del mercato, sia nei movimenti bruschi e improvvisi.

In pratica da quello che è già stato fatto dai mercati con questa tecnica si cerca di dedurre, basandosi sui numeri, il tipo di movimento in atto, i range di oscillazione, sia valutando i valori STATICI, cioè i valori già espressi e presenti sui grafici, sia i valori DINAMICI, non ancora espressi dai grafici in quanto non ancora avvenuti. Con la tecnica step partendo dagli statici, cioè dagli swing precedenti, si cerca di individuare il prossimo step, cioè il prossimo livello nella direzione del trend sia di breve, sia di medio breve.

In pratica gli swing precedenti sul daily e volte sul 60 minuti non solo ci segnalano gli statici, ma sapendoli interpretare, e a questo serve la tecnica new trading moving, ci indicano i valori dinamici che originano i nuovi supporti e resistenze di breve e di medio breve.

Se è vero che gli swing statici ci danno indicazioni su quanto già avvenuto, se noi utilizzassimo per individuare i target gli swing precedenti senza utilizzare per questo scopo gli step cioè gli swing dinamici, potremmo incorrere in svariati errori.

Supponete un titolo che parte da 8,35 e guadagna il 20 % arrivando a 10, da questa quota perde un 10 % e va a 9.

A questo punto guadagna di nuovo il 10 %.

La resistenza statica dove starà? A 10 logicamente, cioè il precedente max.

Lo step invece (dinamico) sarà $9 + 10\%$ cioè a 9,9 e vi sembra più giusto shortarlo a 10? O andare long o mantenerlo in portafoglio sopra 9,9?

E se invece scendesse di nuovo del 10 % una volta toccato 9,9? Semplice, andrebbe a 8,91 (e anche qui lo statico a 9 ci indurrebbe in errore).

Credo che molti uncini e molte false rotture viste con l'analisi tecnica tradizionale derivino invece da questo concetto.

Dall'esempio si comprende anche che con gli step supporti e resistenze sono diversi a seconda se il sottostante sale o se scende, cioè la classica resistenza che una volta superata diventa supporto, è valido solo con l'analisi tecnica tradizionale, molto meno, anche se è di riferimento, con gli Step. Nel caso dell'esempio infatti la resistenza in salita 9,9 non fa da supporto se il titolo la dovesse superare e tornasse indietro. Se ad es da 9 salisse di un altro 20 % arrivando a 10,8 e da lì scendesse di un altro 10% andrebbe a 9,72 e 9,9 non farebbe da supporto sicuro a meno che di assumerlo come nuova posizione long con stop sotto 9,72.

Tutto questo viene applicato anche e soprattutto sui derivati nei trade a breve termine . In questo caso la mia analisi viene effettuata, parlando di indici usa: sul dj index, spesso anche su S&P futures e Nasdaq Futures. Inoltre la utilizzo anche per lo spmib futures e per il crude.

Segnali su derivati ed indici azionari:

Normalmente eseguo un'analisi settimanale che tende a inquadrare in modo chiaro il trend di breve e quello di medio breve, salvo qualche aggiornamento infrasettimanale.

Possiamo avere in certi casi, vicino a zone di inversione sul daily, dei momenti in cui sul breve c'è una tendenza e sul medio breve una opposta, ma sempre ci sarà indicato il livello sopra al quale o sotto il quale le cose cambieranno.

Normalmente quando un indice è ad esempio rialzista di breve e ribassista di medio breve è più volatile, mentre quando saranno entrambi nella stessa direzione, c'è più stabilità, ma ugualmente verranno indicate le resistenze dove prendere profitto e i supporti entro i quali rientrare nella direzione del trend e sotto il quale stoppare.

L'operatività sui segnali è discrezionale in pratica vengono indicati dei livelli sia per meglio capire il trend, sia per decidere il prezzo entry, la direzione e dove posizionare lo stop.

Al momento è tutto ma mi riservo di aggiungere altre informazioni qualora si rendessero necessarie

Alfredo Riccardi