



# Bollinger e Opzioni

Strategist Cagalli Tiziano

### Disclaimer

I pensieri e le analisi qui esposte non sono un servizio di consulenza o sollecitazione al pubblico risparmio. I suddetti servizi non sono configurabili come rapporto di consulenza né di gestione finanziaria che prevede sempre lo studio delle esigenze finanziarie del cliente e della sua propensione al rischio.

L'articolo ha valore esclusivamente informativo e chi scrive non potrà mai e in nessuna forma essere ritenuto responsabile delle conseguenze derivanti dall'uso che il lettore, in totale autonomia ed indipendenza, potrà fare dei dati ottenuti mediante la consultazione del servizio stesso.

Tutte le analisi, le valutazioni e i commenti non intendono assolutamente promuovere alcuna forma di investimento o speculazione. Sono e vogliono essere esclusivamente studi matematici applicati a valori e materiale puramente didattico.

## Future e Opzioni con le Bande di Bollinger

Visto il grande successo del [video per l'operatività real time in future di Cagalli Tiziano](#), a grande richiesta, presentiamo l'applicazione verso un sistema di trading che coinvolge anche le opzioni.

Il video, dal titolo "[Il mercato delle opzioni in real time con le Bande di Bollinger](#)" è disponibile presso lo **shop del sito You Video Live**.

Era stato introdotto con i settaggi per funzionare con il solo **future**, ora presentiamo l'applicazione verso un **sistema di trading che coinvolge anche le opzioni**.

Nel video, **2 coppie di Bande di Bollinger** con 2 settaggi diversi, **costituiscono i 4 punti variabili in tempo reale per entrare od uscire dal mercato seguendo il segnale di una linea di regressione**.

**In pratica, è un sistema che sfrutta un valore previsionale fornito da una regressione nell'ambito di 4 prezzi che calcolano l'errore passato.**

Con questa costruzione abbiamo un **sistema che si autocorregge**, e che sposta continuamente i **target di entrata e di uscita** a seconda del prezzo battuto e del time frame selezionato. La costruzione, basata su **matematica statistica**, non permette grossi draw down mentre lascia inalterata la possibilità di guadagno.

Rispetta perciò la prima regola di trading: **Stoppa le perdite e fai correre i guadagni**.

I sistemi sono validi se sono replicabili e questo lo è stato perchè un **centinaio di persone** (ad oggi), è riuscita ad **applicarlo e a trarne profitto**. Per questo motivo abbiamo avuto moltissime richieste per la **presentazione di un sistema di trading** analogo che coinvolgesse oltre che i **futures anche le opzioni**.

Questo è quello che vi presenteremo **sabato 19 marzo a Milano**. Un **sistema di trading già collaudato da numerosi utenti**, cosa che potete leggere nel nostro forum, ma con le modifiche per poterlo applicare alle opzioni.

**Quindi Opzioni e Future.**

E' risaputo che le **bande di bollinger sono 2 "fasce" che misurano l'errore di previsione del movimento dei prezzi**. Più sono ampie e più il prezzo previsto è stato sbagliato, si restringeranno fino a formare la classica figura dello squeeze quando i prezzi previsionali calcolati sono stati e sono esatti.

Con questa premessa è intuitivo pensare che l'ampiezza di queste bande **identifichi anche la volatilità del prezzo** del sottostante che a sua volta incide sul valore delle opzioni (per questo che si chiamano derivati), e su queste affermazioni tracciare la strada da seguire per la strategia in opzioni.

Vediamo i punti principali che tratteremo:

- **L'ampiezza delle bande ed il vega** come sono correlati;
- Le opzioni da mettere a mercato in presenza di uno **squeeze**, ovvero il restringimento del canale delle bande;
- La **distanza** del prezzo rispetto alla **Banda Up o alla Banda Down determina il moneyness** (cioè se OTM, ATM, ITM) delle opzioni da trattare
- l'utilizzo delle **due bande a deviazione inferiore** per entrare a mercato con le coperture delle opzioni vendute;
- I **futures** entrano in azione come rinforzo della strategia;
- Regole e metodo per la **costruzione del sistema di trading**;

Vi aspettiamo per discutere di questi argomenti e di molti altri **sabato 19 marzo 2011 a Milano**.

Ricordiamo che, come al solito, è un incontro a numero chiuso e si terrà presso il **Grand Hotel Westin Palace in Piazza della Repubblica 20 a Milano a pochi passi dalla stazione centrale**.

**L'orario dell'incontro sarà dalle 10 alle 17,30.**

Colazione prima di iniziare i lavori che interromperemo alle ore 13 con una pausa pranzo. Si riprenderà alle ore 14 per terminare alle ore 17,30 con una pausa caffè di metà pomeriggio, come al solito tutto offerto da PlayOptions.

Per questa iniziativa chiediamo un **contributo spese di euro 300 + IVA**.

[Iscriviti.](#)

Buon trading  
Tiziano Cagalli

Invito chi non conosce questi strumenti a prenderne visione e magari a leggere sul mio sito ([www.PlayOptions.it](http://www.PlayOptions.it)) la sezione didattica.

Scarica gratuitamente, per sempre, il software per costruire le tue strategie in opzioni



**Hai FIUTO per il Trading in Opzioni?**