

Daily swing

Premessa

Innanzitutto **premetto di avere inventato nulla!** Ho adattato metodi, sistemi e ricerche trovate sul forum secondo le mie esigenze.

A quanti sarebbe piaciuto fare trading su di un Future, in modo "sicuro", senza doversi preoccupare troppo di entrate sbagliate o senza l'ansia di portarlo overnight, a me certamente e quindi ho cercato una possibilità che potrebbe e sottolineo potrebbe essere data da questa strategia.

Analisi di base

Alla base della strategia c'è l'analisi della deviazione standard giornaliera del future (o azione) interessato. In questo caso ho preso in esame il nostro Fib; calcoleremo la deviazione standard andando su Fiuto e vediamo qual è la volatilità storica del sottostante, che nel nostro caso è del 17% circa; Il Fib sta quotando 16500 per cui la deviazione standard è di 2805 punti annui che divideremo per 4 e avremo una ds di circa 700 punti (arrotondata) quindi teorizziamo che l'indice si muoverà intorno alla chiusura precedente di 700 punti. (350 punti sopra e 350 sotto)

Dividiamo la ds in 3 parti e creiamo una specie di pivot point con 3 supporti e 3 resistenze a cavallo della chiusura precedente.

A questo punto applicheremo al metodo una martingala in controtendenza che inizia con l'acquisto (o vendita) di 1 unità con il raddoppio a 2 e quindi a 4, non senza avere adeguatamente protetto il nostro trade.

La necessità di protezione è data anche dal fatto che in questo modo i margini dovuti per i minifib sono quasi azzerati.

Esempio

3.a resistenza	17010 -4
2.a resistenza	16780 -2
1.a resistenza	16550 -1
Chiusura precedente	16320
1.o supporto	16090 +1
2.o supporto	15860 +2
3.o supporto	15630 +4

Gli strumenti che intendo utilizzare sono il minifib e le opzioni mibo settimanali per cui devo fare una prima considerazione e cioè che ogni opzione mi copre 2,5 minifib per cui con 3 opzioni copro l'intero pacchetto di minifib.

Entrata a mercato

Quando il minifib raggiunge la prima resistenza o il primo supporto acquisto (vendo) 1 minifib e contemporaneamente acquisto una call o una put settimanale a protezione, a discrezione può essere più o meno lontana, ma non deve mai superare i limiti della 3.a resistenza o supporto.

Se il mercato prosegue la sua strada nella stessa direzione provvederò ad acquistare (vendere) prima 2 minifib e un'altra protezione e poi ulteriori 4 minifib e la 3.a call o put a protezione. La protezione non è ovviamente "integrale" perché il delta delle opzioni acquistate non sarà uguale a quello dei 7 minifib, però ci darà modo di costruire il nostro piano B e C (che vedremo in seguito)

Uscita dal mercato

Se il mercato storna dal livello 1 al livello della chiusura precedente o da un livello superiore ad un livello inferiore è il momento di uscire dal mercato, liquidando tutto, minifib e protezioni.

Esempio: Poniamo di essere entrati in acquisto di 1 minifib a 16090 e di avere acquistato una put 15900 (vicina al 2' livello) a 102 punti, se il mercato torna a 16320 chiudo tutto vendendo il minifib con un utile 230 punti (230€) e vendo la put che si sarà deprezzata a 60 con una perdita di 42 punti (105€)

Netto 125 € - 10€ commissioni.

Nota: A questo punto il livello a cui siamo usciti diventa il livello =0= per una nuova salita o discesa, mi spiego con un esempio: se come sopra siamo entrati al livello 1S e siamo usciti al livello =0= nel caso tornasse al livello 1S entreremo di nuovo a mercato al livello 1S se invece fosse toccato il livello 2S e quindi fossimo usciti al livello 1S, entreremo di nuovo a mercato al livello 2S ma cominciando la martingala da lì quindi con 1 contratto e non con 2, questo comportamento deriva dalla considerazione che se il mercato fosse forte in una direzione, potrebbe anche superare la deviazione standard per cui allunghiamo le distanze. Questo è un comportamento che tengo io ma non è indispensabile, si potrebbe continuare a entrare ed uscire in trading range prendendo quante più onde possibili.

Varianti

Con gli scalini formati come sopra, nei giorni di minore volatilità non si entrerà quasi mai a mercato, per cui volendo si potrà dividere la ds in 4 per cui gli scalini sarebbero più bassi; in questo caso per non allungare troppo la martingala, inizieremo dal 2' livello, uscendo sempre dal livello inferiore come descritto sopra.

Esempio

4.a resistenza	16660 -4
3.a resistenza	16575 -2
2.a resistenza	16490 -1
1.a resistenza	16405
Chiusura precedente	16320
1.o supporto	16235
2.o supporto	16150 +1
3.o supporto	16065 +2
4.o supporto	15980 +4

Piano B

La difesa di un'entrata sbagliata data da una deviazione standard abnorme è già insita nel metodo, dato che ad ogni minifib messo a mercato, si acquista la relativa copertura, addirittura in eccesso perché al massimo ci troveremmo a mercato con 7 minifib e con 3 opzioni che coprono 7,5 minifib, però abbiamo in mano delle opzioni settimanali, che abbiamo scelto perché costavano meno delle mensili o delle trimestrali che sarebbero quelle che ci danno una copertura a scadenza del 100% anzi del 107.14%

Dobbiamo quindi intervenire e per farlo abbiamo più metodi da utilizzare in modo differente a seconda di quanti giorni mancano alla scadenza del future e quanta distanza ci separa dal nostro prezzo di carico:

1-Se siamo in scadenza delle settimanali e l'indice ha perso 2 ds cioè 1400 punti, nel caso ipotizzato sopra mi troverei con 7 minifib al prezzo medio di 15760 e 3 put 15900, acquistate al prezzo medio di 145 punti; il mercato raggiunge la seconda deviazione standard e quindi scende a $16320 - 700 - 700 = 14920$ avrò perso 5880€ dai minifib ($15760 - 14920 = 840 \times 7$) e guadagnato 6260€ dalle put 15900 ($15900 - 14920 = 980 \times 3 = 2940 \times 2.5 = 7350 - (145 \times 3 \times 2.5) = 1087.5 = 6262.5$)

2-Mediata verticale, da mettere in essere se fossimo nel mese di scadenza del future; la mediata verticale prevede l'acquisto di call (o put) a strike più basso (più alto) pari alla quantità di sottostante che è in nostro possesso e la contemporanea vendita del doppio delle opzioni a strike più alto (più basso per le put)

Esempio: nel caso ipotizzato sopra mi troverei con 7 minifib al prezzo medio di 15760 e 3 put 15900, acquistate al prezzo medio di 145 punti; il mercato raggiunge la seconda deviazione standard e quindi scende a $16320 - 700 - 700 = 14920$

Acquisto 3 call marzo (stiamo trattando il fib marzo) strike 15000 e vendo 6 call 15500.

(Intanto ricordo avrò perso 5880€ dai minifib e guadagnato 6260€ dalle put)

3-Vendita di opzioni modello CCW allo strike più prossimo al nostro prezzo di carico qualora si fosse mosso in prossimità della ds

4-Montante americana, nel caso invece fossimo all'inizio del trimestre diciamo nel primo mese circa, dovremo instaurare una montante americana, con incremento di 1 numero finale ogni volta che si supera la ds cioè ogni 700 punti e ovviamente con la vendita contemporanea di opzioni.

Al fine di calmierare i margini, è opportuno acquistare delle opzioni a protezioni OTM che saranno finanziate da parte del ricavato dalla vendita delle opzioni.

5-Future sintetico (+3call -3put) a bilanciare i mini acquistati

Certamente ci saranno anche altri piani B o C da mettere in essere a seconda delle proprie attitudini e/o esperienze personali