

TRADING LIBRARY



Money Monitor & Trailing Stop calculator Creazione PlayOptions.

Money Monitor

DDE / Setup Real Time Mini Carica Salva

Tipo Entrata	<input type="button" value="Long"/> <input type="button" value="Short"/>	Prezzo Attuale	7.34 €
Quantità	<input type="text" value="2000"/>	Esci a	<input type="text" value="7.61 €"/>
Prezzo Entrata	<input type="text" value="7.11"/>	Stop a	<input type="text" value="6.935 €"/>
Target Guadagno	<input type="text" value="1000"/> 7.0 %	Gain/Loss	€ 460,00
Trail-Stop %	<input type="text" value="10"/>		
Stop Loss €	<input type="text" value="350"/> 2.5 %		

17/10/2008 14.56.48 - Tol Expò 2008
Trading Library & PlayOptions vi danno appuntamento il 30 e 31 ottobre a Milano - Palazzo Mezzanotte - alla 6° edizione del Tol Expò

TRADING LIBRARY PlayOptions.it

Presentazione

Software di interfaccia ai dati in tempo reale (DDE) della posizione da seguire.

Per informazioni sul Metodo di Trailing Stop leggere la nota finale

- Calcola i massimi e minimi relativi riferiti alla percentuale del Trailing stop e segnala in forma audio e in forma grafica lo stato dell'operazione ad ogni ricezione di Tick;
- Permette la *gestione ottimale di qualsiasi operazione* in Trailing ottenendo i massimi risultati dal trend in atto;
- Impostati i valori dell'operazione e collegato in DDE alla fonte dati calcolerà Tick by Tick il procedere dell'operazione medesima;
- Un *suono avvertirà* se il Tick ricevuto è favorevole/contrario/uguale al precedente;
- Visualizza il Gain/Loss istantaneo;
- Visualizza il valore di uscita che, finché non si è raggiunto il Target Gain, sarà esattamente il valore dello Stop Loss, poi sarà il valore calcolato al quale uscire, avendo messo come massimo rischio una percentuale del Gain. Tale soglia sarà sempre più ampia all'aumentare del Gain;
- Appena il prezzo ricevuto coinciderà con il valore calcolato, il software emetterà un nuovo è più intenso suono, il display lampeggerà, avvertendo *l'operatore che è il momento di uscire dalla posizione !*
- Ha la caratteristica di poter essere *ridotto a Mini*;
In questo caso il display visualizzerà solo i valori che interessano.
L'interfaccia avrà una dimensione tale da non disturbare altre applicazioni, e *rimarrà sempre in primo piano*;
- Una spia luminosa *da verde diventerà rossa* per avvisare che la connessione online è attiva o meno o che è trascorso troppo tempo dall'ultima ricezione del Tick;

Settaggi

DDE / Setup

Settaggio ricevimento dati DDE



Provider

Dal menù a tendina selezionare il provider tra quelli presenti e poi nella tendina Strumento selezionare lo strumento desiderato.

Nel caso il provider oppure lo strumento desiderato non siano presenti nei menù, è possibile proseguire in questo modo:

- scegliere *Manuale* come provider;
- inserire la stringa di connessione DDE dalla quale si vogliono ricevere i dati, tale da completare i campi "Server", "Topic", ed "Item" come specificato nell'esempio seguente:

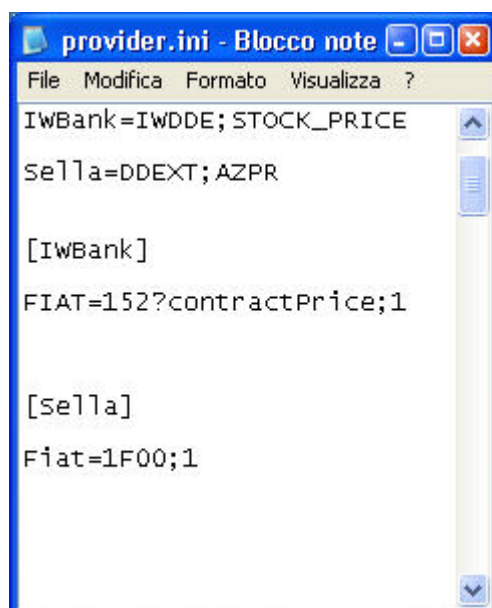
```
=IWDDE|STOCK_PRICE|'152?contractPrice'
```

avendo cura di togliere i caratteri: `= | '` e scomponendo la stringa in tre parti

`=` `IWDDE` `|` `STOCK_PRICE` `'` `152?contractPrice` `'`

Provider IWBank

Per personalizzare o aggiungere provider e/o strumenti non presenti nei menù, cliccare con il mouse sul testo Provider oppure Strumento a sinistra dei menù. Verrà aperto il file nel quale sono presenti le stringhe DDE suddivise per provider DDE e per strumenti.



```
provider.ini - Blocco note
File Modifica Formato Visualizza ?
IWBank=IWDDE; STOCK_PRICE
Sella=DDEXT; AZPR

[IWBank]
FIAT=152?contractPrice;1

[Sella]
Fiat=1F00;1
```

Aggiungere nella sezione [provider] il provider seguito dal Server, il punto e virgola ed il Topic DDE dal quale si desidera ricevere i dati.

Creare poi una sezione relativa al provider [mio provider], inserire il nome dello strumento seguito dal segno (=) ed infine inserire l'item dello strumento, il punto e virgola, ed il *point value*

Queste stringhe si ottengono dal DDE dal Fornitore.

Esempi:

Per ricevere i dati di **STM** da **Banca Sella** (**SellaExtreme**) la stringa DDE è la seguente:
=DDEXT|AZPR!1STM00

Server = **DDEXT**

Topic = **AZPR**

Item = **1STM00**



Per ricevere i dati di **STM** da **IwBank** (**QuickTrade**) la stringa DDE è la seguente:
=IWDDE|STOCK_PRICE!'331?contractPrice'

Server = **IWDDE**

Topic = **STOCK_PRICE**

Item = **331?contractPrice**



Per ricevere i dati di **STM** da **IntesaTrade (T3)** la stringa DDE è la seguente:
=T3_DDE_SERVER|T3_DDE_QUOTE_TOPIC! MI.EQCON.559@last_price

Server = **T3_DDE_SERVER**
Topic = **T3_DDE_QUOTE_TOPIC**
Item = **MI.EQCON.559@last_price**



Per ricevere i dati di **STM** da **VisualTrader** la stringa DDE è la seguente:
=VTTOOLS|Tlink!STM_L

Server = **VTTOOLS**
Topic = **Tlink**
Item = **STM_L**



Per ricevere i dati di **STM** da **Fineco (PowerDesk)** la stringa DDE è la seguente:
=FDF|Q!STM;2

Server: **FDF**

Topic: **Q**

Item: **STM;2**



Per ricevere i dati di **STM** da **ProRealTime** la stringa DDE è la seguente:
=prortdde|Q!STM;2

Server: **prortdde**

Topic: **11_STM**

Item: **Last**



Point Value

Il Point Value è il valore in Euro (o in altre valute) assegnato dalla rispettiva borsa di trattazione per ogni punto di variazione del sottostante. Se prendiamo come esempio l'EURO STOXX 50, che ha un Point Value pari a 10, e supponiamo il valore dell'indice a 4000, quando varierà di un punto (quindi varrà 3999 oppure 4001), il nostro portafoglio avrà avuto una variazione di:

1 punto indice x 10 point value = 10 €.

Per le Azioni: essendo già espresse in Euro (o altre valute) il Point Value è 1.

Per gli Indici, Future su Indici, Future su Obbligazioni, Opzioni: su questi strumenti il Point Value si rileva dalle specifiche del contratto (Borsa di riferimento).

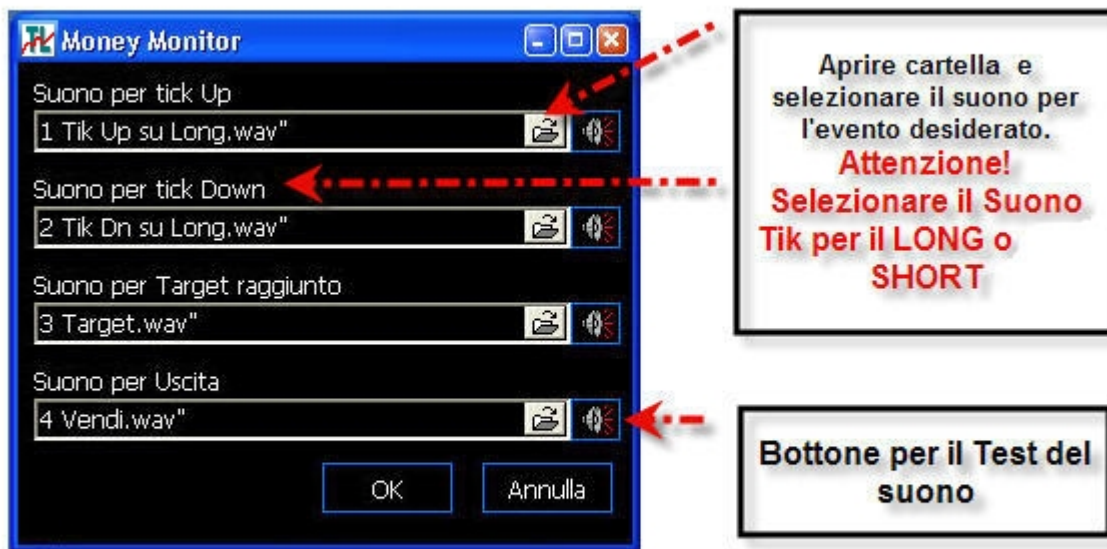
Di seguito sono riportati i più comuni:

S&P MIB	5
Opzioni su S&P MIB	2,5
DAX	25
Opzioni su DAX	5
EURO STOXX	10
Opzioni su EURO STOXX	10
BUND, BOBL e SCHATZ	1.000
Opzioni su BUND, BOBL e SCHATZ	1.000
Euro/Dollaro	125.000
Opzioni su Euro/Dollaro	125.000



Settaggio suoni

NB: nel file del software è già presente una serie di suoni per tutti gli eventi.



Carica

Salva

Salvataggio sessione

e riapertura di una o tutte le posizioni:

Con i bottoni Carica e Salva si eseguono le operazioni indicate.



Quando nella cartella sono salvate più di una operazione, sarà possibile aprire una o tutte le operazioni in una unica soluzione cliccando nell'icona *Auto Launch* che si trova nel menù Avvio di Windows.



Features

Mini

Riduzione a Mini

Con il bottone *Mini* si riducono le dimensioni dell'interfaccia che a questo punto rimarrà sempre in primo piano, per ritornare alle dimensioni normali sarà sufficiente un doppio click in una qualsiasi parte nera della finestra.



Esci a

Caratteristica Display

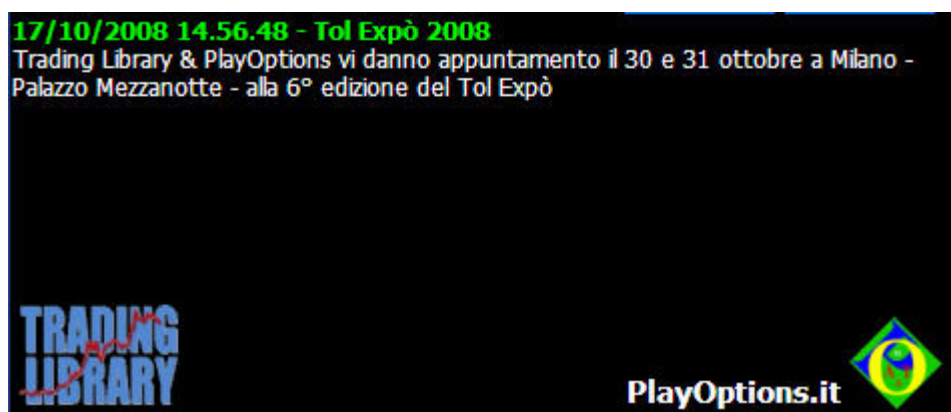
Se sono entrambi presenti : il Gain e lo StopLoss
Se presente solo "Esci a" il Valore al quale è garantito
il Gain meno il % Trail



Tik Up, Tik Down, Tik the same.

Message Center

Finestra che in maniera automatica comunica all'utente news, di carattere informativo o di carattere tecnico (es. nuovi aggiornamenti software da scaricare)



Il MessageCenter rimarrà sempre visibile tranne che nella visualizzazione "Mini".

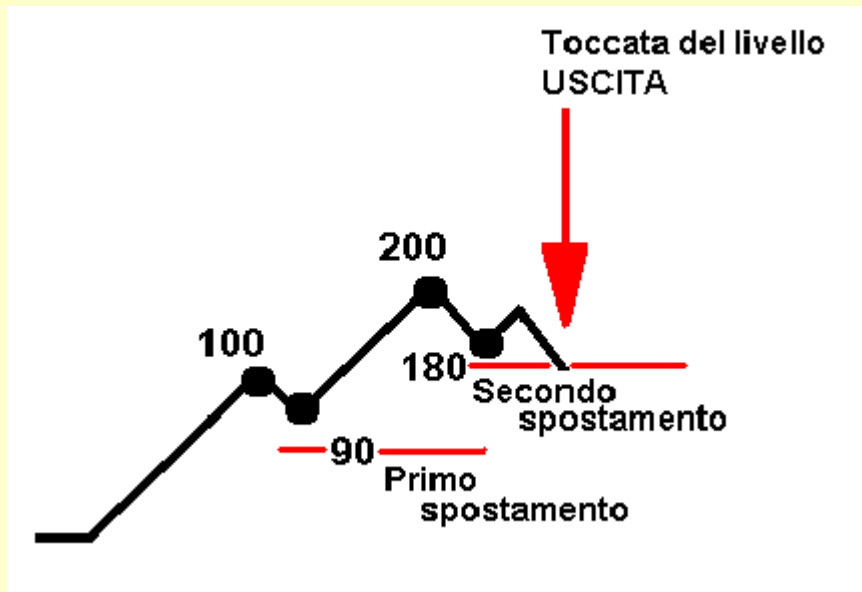
Educational

Il Trailing Stop

La tecnica del Trailing stop serve per seguire la posizione man mano che essa inizia a svilupparsi sollevando o abbassando lo stop Loss, a seconda che siamo rispettivamente in posizione d'acquisto o in posizione di vendita allo scoperto.

In pratica al raggiungimento del valore Target/Guadagno si sposta lo StopLoss per garantire un guadagno in caso di rintracciamento del prezzo e si rimane a mercato per poter approfittare di tutto il movimento di prezzo a nostro favore.

Mano a mano che il guadagno aumenta, il livello di Uscita sarà posizionato sotto il prezzo ed ad una distanza dallo stesso pari alla differenza percentuale Trail-Stop.



Supponiamo di avere una posizione Long. Fissiamo uno Stop Loss ed un Gain a 100.

Entriamo a mercato ed il prezzo scende.

Raggiungiamo lo StopLoss ed usciamo.

Il prezzo sale e a 100 di Gain usciamo. Il prezzo sale ancora ma noi siamo fuori dal mercato!

Vediamo la stessa operazione usando il Trailing Stop.

Aniché fissare un Gain, stabiliamo un Target Gain a 100.

Il prezzo sale:

raggiungiamo il Target di Gain prefissato a 100

abbiamo stabilito di fare Trail con il 10% del Gain per cui fissiamo l'uscita a 90 che è 100 di Gain - 10%

il prezzo ritraccia sino a 95 e poi risale

Sale e a 200 di Gain il nostro livello di uscita è (10% = 20) di 200-20 = 180

il prezzo sale e poi ritraccia. Tocca il nostro livello dei 180 e noi usciamo dal mercato.

In questo modo settando una percentuale sul Gain già ottenuto si riesce ad assorbire gli inevitabili ritracciamenti di prezzo, rimanendo a mercato e potendo così sfruttare i trend consistenti.

Come testare il MoneyMonitor

Sistema di trading semplice ma vincente...

ovvero, non sempre le soluzioni complesse sono le migliori soluzioni

La nostra società si occupa di Trading in Opzioni, però, durante i corsi che teniamo per l'apprendimento delle tecniche di negoziazione di questi strumenti, spesso usiamo con i nostri corsisti un sistema di trading diretto sul sottostante che offre immediate possibilità di valutazione.

Ogni sistema di Trading deve essere collaudato per un certo periodo di tempo prima di essere adottato nel mercato reale con denaro reale. Anche quello che proponiamo di seguito segue questa regola. Utilizzatelo in trading simulato fino a che non avrete trovato il giusto settaggio del time frame sul quale applicarlo e la lunghezza, i periodi cioè, delle Medie Mobili con cui è costruito.

Il Progetto

Vogliamo cercare un indicatore semplicissimo che ci permetta di avere dei segnali affidabili di entrata a mercato. I segnali dovranno essere due: Long e Short. Utilizzeremo poi il sistema in due modi distinti: entreremo a mercato solo nel momento in cui arriverà il segnale di Buy o di Sell oppure rientreremo continuamente a mercato non appena la gestione del MoneyMonitor lo permetterà. Quindi nel primo caso avremo una sola entrata per ogni segnale, nel secondo caso il segnale ci dirà quando entrare la prima volta e da che parte entrare nelle successive.

Vogliamo usare le classiche Medie Mobile ma vogliamo anche ridurre al massimo il "ritardo" alla risposta che questo tipo di sistema produce. In genere si usano due Medie Mobili semplici di periodi diseguali. Per verificare la NON validità di tale sistema tanto, troppo spesso pubblicizzato, adottiamo la classica doppietta di periodi il 9 ed il 15. Il Time Frame lo settiamo per questa prova a 5 minuti. Vale a dire che ogni barra viene calcolata ogni 5 minuti.

Definiamo come regola di entrata a mercato il momento in cui avviene l'incrocio delle Medie e precisamente:

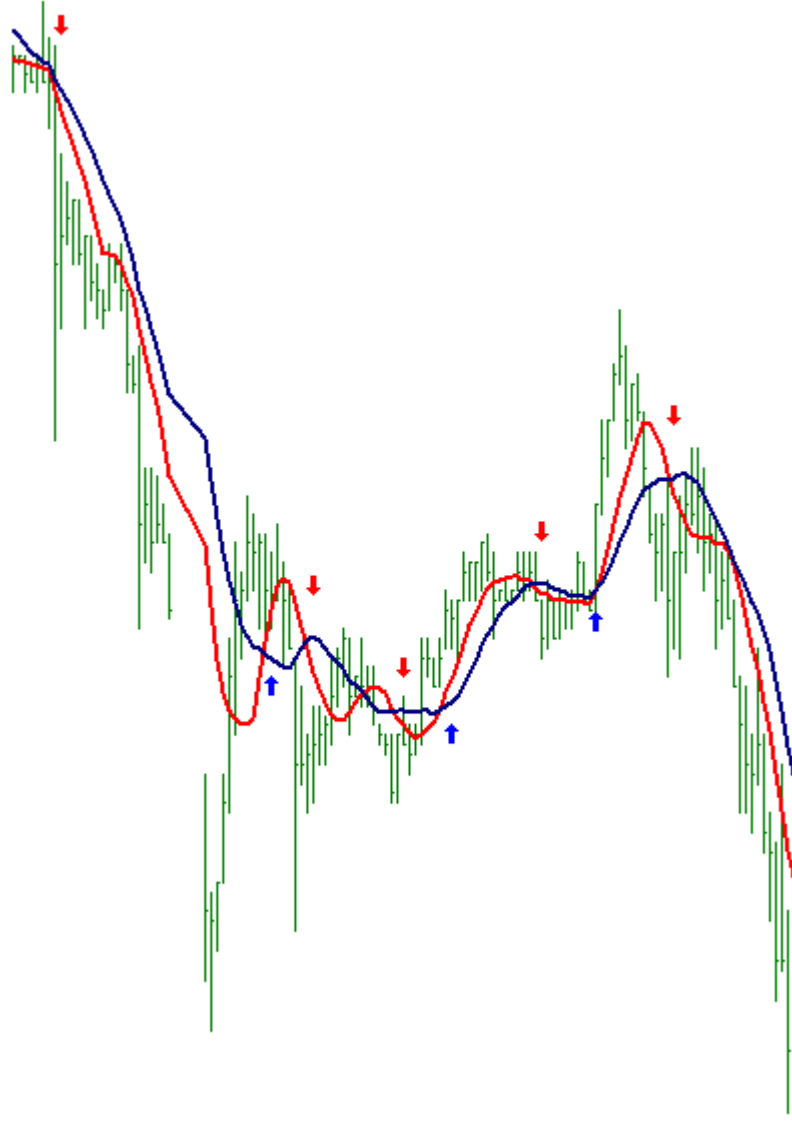
entro Long (Buy) appena la Media Mobile a 9 periodi di colore Rosso, attraverserà dal basso verso l'alto la Media Mobile a 15 periodi di colore Bianco;

entro Short (Sell) appena la Media Mobile a 9 periodi di colore Rosso, attraverserà dall'alto verso il basso la Media Mobile a 15 periodi di colore Bianco.

Abbiamo deciso di effettuare il Test, investendo 10.000 euro e di farlo sul titolo Telecom Italia effettuando le entrate secondo le regole prestabilite.

TLIT.MI LAST-5 min

C=.828 .000 +0.00% O=.895



Performance Summary: All Trades

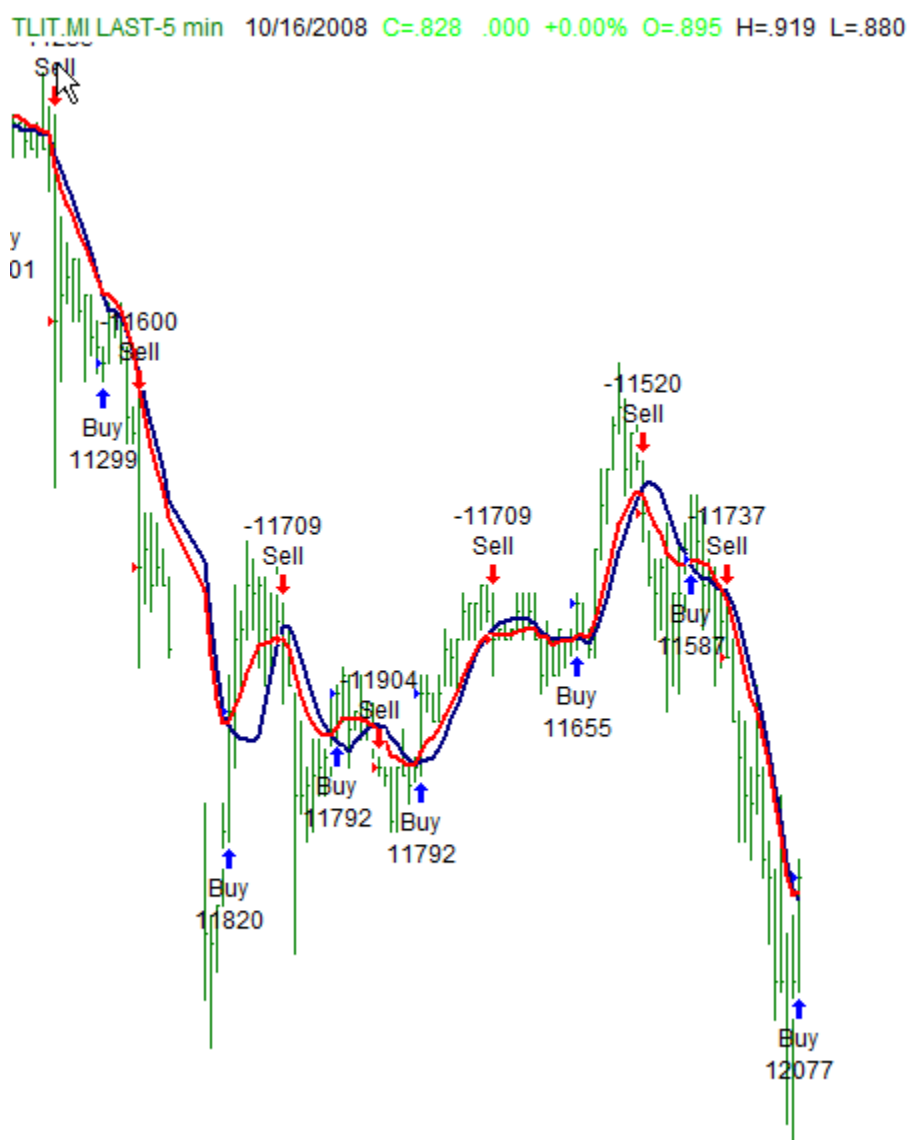
Total Net Profit	\$1.533,25	Open position P/L	\$360,87
Gross Profit	\$4.348,33	Gross Loss	(\$2.815,07)
Total # of trades	46	Percent profitable	41,30%
Number winning trades	19	Number losing trades	27
Largest winning trade	\$1.159,19	Largest losing trade	(\$405,57)
Average winning trade	\$228,86	Average losing trade	(\$104,26)
Ratio avg win/avg loss	2,20	Avg trade (win & loss)	\$33,33
Max consec. Winners	4	Max consec. losers	4
Avg # bars in winners	18	Avg # bars in losers	7
Max intraday drawdown	(\$1.235,46)		

Anche se il risultato è positivo, non si può non notare che le entrate sono **ritardate** e si perde il momento decisivo. Infatti la quasi totalità del guadagno è stata ottenuta in un unico trade e quelli vincenti sono solo il 41,30%.

Abbiamo perciò introdotto una modifica semplice ma **decisiva**. Abbiamo portato le Medie Mobili alla stessa lunghezza (periodo) mettendone una, quella di colore Rosso, **Esponenziale** anziché normale.

Il vantaggio è che essendo dello stesso periodo saranno molto più reattive, daranno meno falsi segnali e saranno molto più immediati.

Sempre sullo stesso titolo e con la stessa quantità di denaro riproviamo il sistema con queste modifiche ed il risultato ottenuto dimostra la bontà della nuova modifica. Infatti la percentuale di trade vincenti è salita al 54,24% ed il numero di entrate è salito da 46 a 59.



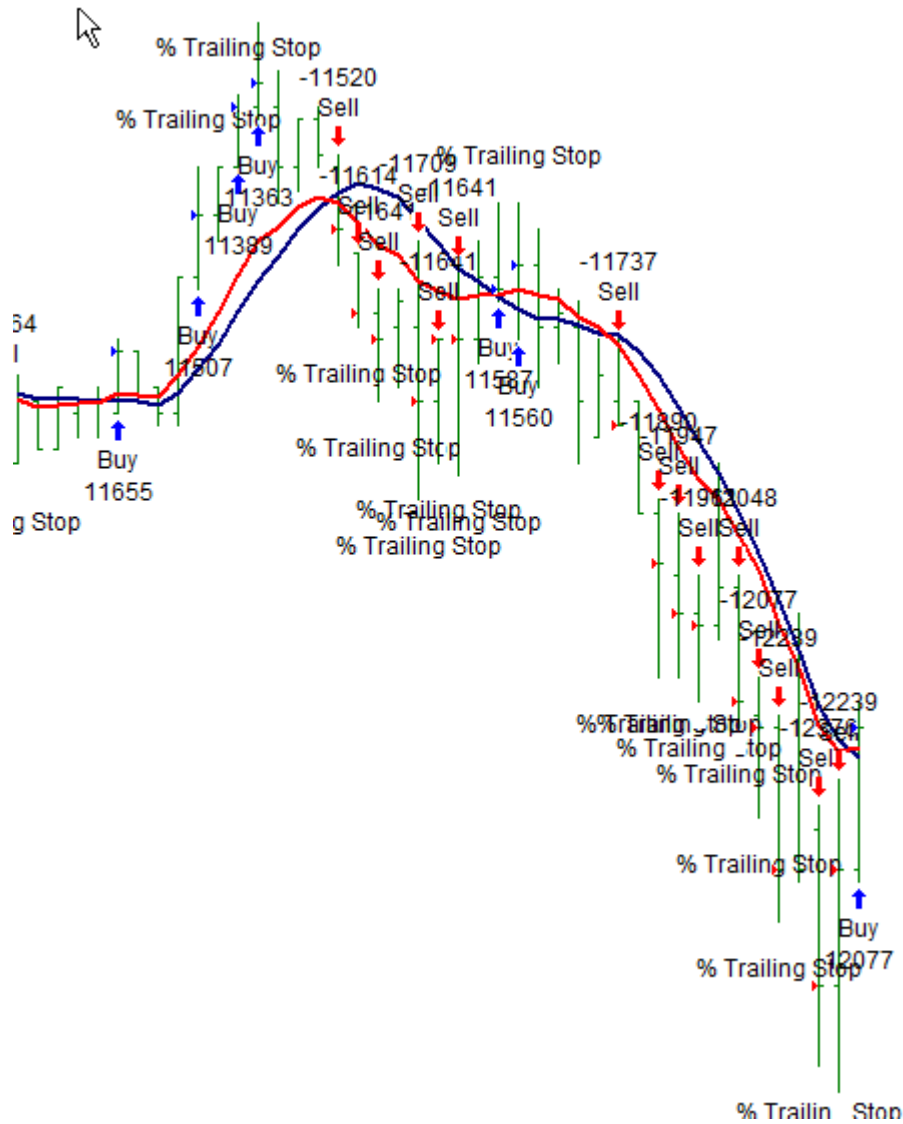
Performance Summary: All Trades

Total Net Profit	\$2.492,61	Open position P/L	\$0,00
Gross Profit	\$6.182,97	Gross Loss	(\$3.690,36)
Total # of trades	59	Percent profitable	54,24%
Number winning trades	32	Number losing trades	27
Largest winning trade	\$1.145,30	Largest losing trade	(\$541,24)
Average winning trade	\$193,22	Average losing trade	(\$136,68)
Ratio avg win/avg loss	1,41	Avg trade (win & loss)	\$42,25
Max consec. Winners	9	Max consec. losers	4
Avg # bars in winners	12	Avg # bars in losers	6
Max intraday drawdown	(\$1.747,36)		

A questo punto vogliamo introdurre il MoneyMonitor.

In pratica settiamo il sistema affinché ci guidi nella seguente gestione:

entro con 10.000 euro e appena sono in Guadagno di 100 euro metto a rischio il 10%. Significa che se il titolo rintraccerà ed il guadagno scende a 90 euro esco. Chiaramente se il titolo prosegue e arriva a 200 euro di Gain il rischio rimane del 10% ma il rintracciamento ammesso sarà di 20 euro. E così via. Naturalmente uscirò se anziché andare subito in Gain la mia posizione entrerà in perdita di 500 euro.



Performance Summary: All Trades

Total Net Profit	\$6.735,78	Open position P/L	\$0,00
Gross Profit	\$12.504,61	Gross Loss	(\$5.768,83)
Total # of trades	180	Percent profitable	72,78%
Number winning trades	131	Number losing trades	49
Largest winning trade	\$878,04	Largest losing trade	(\$541,24)
Average winning trade	\$95,46	Average losing trade	(\$117,73)
Ratio avg win/avg loss	,81	Avg trade (win & loss)	\$37,42
Max consec. Winners	11	Max consec. losers	3
Avg # bars in winners	3	Avg # bars in losers	4
Max intraday drawdown	(\$1.162,91)		

Il risultato è sorprendente: il guadagno ottenuto nello stesso periodo di tempo è aumentato di circa il triplo ed il numero dei trade in cui il sistema è stato corretto è del 72%. Infatti su 180 trade 131 sono stati vincenti e 49 sono quelli in perdita.