eBook

PDB TRADING SYSTEM

Battere i mercati con probabilità dell'80%

ProiezionidiBORSA
UN IMPORTANTE RIFERIMENTO NEL MONDO DELLA FINANZA

PdB Trading System

Battere i mercati con probabilità dell'80%

Titolo
"PdB Trading System"

Autore
www.proiezionidiborsa.com

Editore
www.proiezionidiborsa.com

Siti internet
https://www.thecalculator.it/

ATTENZIONE: investire in Borsa è rischioso

Le strategie riportate in questo libro sono frutto di anni di studi e specializzazioni, quindi non è garantito il raggiungimento dei medesimi risultati economici. I risultati passati ottenuti dall'autore non forniscono alcun tipo di garanzia per i guadagni futuri.

Il lettore si assume piena responsabilità delle proprie scelte economiche e finanziarie, consapevole dei rischi connessi a qualsiasi forma di investimento in Borsa.

I casi di studio e gli esempi contenuti nel testo sono frutto di notizie e opinioni che possono essere modificate in qualsiasi momento senza preavviso e non costituiscono sollecitazione all'acquisto o alla vendita di valori mobiliari e al pubblico risparmio.

L'unico scopo è di fornire elementi di studio sull'andamento dei mercati, pertanto non possono essere considerate come previsioni certe e non mettono al riparo dal rischio insito nelle operazioni di investimento in titoli.

L'Autore e l'Editore declinano ogni responsabilità su eventuali inesattezze dei dati riportati, danni, perdite economiche, danni diretti o indiretti derivanti dall'uso o dalla divulgazione delle informazioni contenute in questo libro.

Sommario

SOMMARIO **3**

INTRODUZIONE **4**

LE STATISTICHE **6**

Come è definita la tendenza? 6

Le variabili in gioco 6

Statistiche giornaliere 7

COME VENGONO INDIVIDUATE OGNI SERA LE OPERAZIONI PER IL GIORNO DOPO? **9**

COSA DOVRANNO FARE OGNI SERA GLI UTENTI REGISTRATI AL SERVIZIO? **122**

CONCLUSIONI **144**

APPENDICE 1 **155**

Introduzione

In Italia e nel mondo i segnali di trading hanno subito notevoli variazioni nell'ultimo decennio. Dai semplici dettami della legge di Dow si è passati ad algoritmi e a robot che operano secondo i criteri più disparati.

L'unica azienda che nel settore è stata davvero innovativa è ProiezionidiBorsa in quanto continua da applicare criteri basati su serie storiche e calcoli di probabilità redatti da profili altamente professionali. Negli anni chi ci segue ha potuto toccare con mano la valenza non solo delle nostre previsioni ma anche delle nostre operazioni di trading.

Abbiamo deciso di andare oltre e attraverso uno studio di prezzo, tempo e volume abbiamo elaborato PdB Trading System.

Cos'è PdB Trading System?

Immaginate ogni giorno un calcolatore al vostro servizio che:

a) sceglie i titoli (fra i 40 titoli ad ampia capitalizzazione) del Ftse Mib e gli indici azionari/futures (Dax, Eurostoxx, Ftse Mib, S&P 500,Bund,Btp) che hanno una tendenza definita con probabilità dell'80%;
b) definisce l'operatività Long/Short;
c) definisce il punto di ingresso in operazione che ha probabilità di portare in guadagno l'operazione stessa;
d) definisce lo stop-loss con probabilità che possa essere toccato solo fra il 18 ed il 23% dei casi;
e) definisce 3 punti di take profit che possono essere toccati con probabilità del 40%, 70% e 90%.

L'operazione di Trading tipo è:

L'operazione di trading intraday tipica invece è:

Long/Short da xxxxx o a valori inferiori/superiori con Stop a xxxxx e Take Profit a xxxxx. Se non scatta lo Stop o il Take profit l'operazione verrà chiusa 5 minuti prima del time frame giornaliero.

Cosa significa valori inferiori?

Se ad esempio abbiamo stabilito Long da 10 ma apre a 9 l'ingresso avverrà automaticamente a

Cosa significa valori superiori?

Se ad esempio abbiamo stabilito Short da 10 ma apre a 11 l'ingresso avverrà automaticamente a 11.

Elenco indici/titoli trattati da PdBTradingSystem

Nome
FTSE MIB40 Full1219
ESTOXX50 Full1219
Euro Bund Full1219
DAX30 Full1219
S&P500 Index

Nome
ATLANTIA
AUTOGRILL SPA
AZIMUT
BANCA GENERALI
BREMBO
BUZZI UNICEM
CAMPARI
CNH INDUSTRIAL
DE LONGHI
DIASORIN
ENAV
ENEL
ENI
ERG
EXOR
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES
GENERALI ASS
HERA
I.M.A
INTERPUMP GROUP
ASTM
INTESA SANPAOLO
IREN
ITALGAS
LEONARDO
MEDIASET S.P.A
MEDIOBANCA
MONCLER
PIRELLI & C
PRYSMIAN
RECORDATI ORD
SAIPEM
SALVATORE FERRAGAMO
+ SIAS
SNAM
STMICROELECTRONICS
TELECOM ITALIA
TENARIS
TERNA
UBI BANCA
UNICREDIT
UNIPOL
UNIPOLSAI

Vi sembra magia o qualcosa di irrealizzabile? Invece da oggi è possibile ed i segnali sono semplici da leggere e facili da applicare.

Continuate a leggere i prossimi paragrafi.

Le statistiche

L'idea di questo sistema nasce dall'esigenza di rispondere alle domande che ogni trader si pone quando studia l'operazione che vuole intraprendere sul mercato per un dato strumento

Quali sono i livelli chiave?

Che probabilità ho di centrare il mio target?

Che probabilità ho di andare in stop?

Quante volte consecutive la posizione può andare in stop?

Come consuetudine, ProiezionidiBorsa ha risposto a queste domande andando ad analizzare lo storico disponibile per ogni strumento e realizzato per ognuno lo schema riportato qui di seguito. Sul significato delle variabili mostrate nello schema ci ritorniamo in seguito.

Come è definita la tendenza?

La tendenza viene definita con probabilità del 80% attraverso uno studio scrupoloso delle serie storiche e di calcoli statistici.

Long significa quindi che sul time frame indicato verranno segnati con probabilità del 80% un minimo e massimo superiore rispetto al time frame precedente;

probabilità fra il 18 ed il 23% che si vada sotto il minimo del time frame precedente

Le variabili in gioco

Per ogni strumento in chiusura di ogni seduta andiamo a calcolare

Il punto d'ingresso

Target con 70% di probabilità=rappresenta il prezzo obiettivo che verrà raggiunto con una probabilità del 70%

Target con 90% di probabilità== rappresenta il prezzo obiettivo che verrà raggiunto con una probabilità del 90%

Target esteso (TPEXT) = rappresenta l'obiettivo più estremo dell'operazione. La probabilità che tale obiettivo venga raggiunto è dato nella tabelle delle statistiche riportate qui di seguito.

Stop = rappresenta la probabilità che venga raggiunto lo stop che nel caso di posizioni LONG/SHORT

Stop Cons = rappresenta la media del massimo numero di operazioni consecutive in cui l'operazione va in Stop.

Sigma = è una variabile che sintetizza le condizioni del mercato: **prezzo, volume e tempo**. Cosa si intende per "condizioni del mercato"?

Ogni seduta di Borsa è diversa dalla precedente. Partendo da questa osservazione banale, abbiamo sviluppato l'indicatore SIGMA (prezzo, volume e tempo) attraverso il quale siamo riusciti a categorizzare le sedute di Borsa in modo da evidenziarne le caratteristiche principali e a calcolare in modo più accurato le statistiche relative a ciascuna variabile considerata.
Esempio: dire che una condizione ha il 50% di probabilità di verificarsi non vuol dire nulla. Trovare la condizione che permetta di dividere lo storico in modo tale che in un caso c'è il 20% e nell'altro l'80% di probabilità che si verifichi una determinata condizione è molto più utile.

Statistiche giornaliere

Queste statistiche rappresentano, in funzione della variabile SIGMA, la probabilità che si verifichi una determinata condizione.

Prima di procedere facciamo notare che per alcuni degli indici e delle azioni principali abbiamo riportato in Appendice 1 le probabilità specifiche dello strumento trattato e non il valore medio.

Supponiamo di stare operando con un indice, che il segnale per il giorno dopo sia LONG e che la SIGMA sia compresa tra 2 e 3. In questo caso devo andare a guarda la Tabella 1. Quali sono le informazioni che ricavo da questa tabella e come posso utilizzarle?

Innanzitutto devo sapere che la probabilità che la mia operazione LONG raggiunga il prezzo di ingresso è l'80,76%. Nel restante 20% circa il prezzo di ingresso non viene raggiunto e, quindi, rimango flat tutto il giorno.

Supponiamo ora che l'operazione raggiunga il prezzo di ingresso cosa devo fare?

Tutto dipende dalla propensione al rischio dell'investitore.

Un investitore prudente può pensare di mettere come target il prezzo che ha probabilità del 90% di essere raggiunto (TP90). Quello meno prudente il TP70, quello più incline al rischio potrebbe scegliere come obiettivo TPEXT che, nel caso in questione, avrebbe una probabilità del 30,21% di essere raggiunto.

Un discorso a parte riguarda lo Stop che, come si vede dalla Tabella 1 ha una probabilità del 17,19% di essere raggiunto. Al raggiungimento dello Stop l'investitore deve:

Portare a casa la perdita e aspettare il giorno successivo.

Un discorso a parte merita la variabile Stop Cons. Il valore indicato in Tabella 1 è pari a 3,8 per il caso in esame. Esso rappresenta la media del massimo numero di operazioni consecutive in cui l'operazione va in Stop.

Perché è importante questo numero?

Immaginiamo di avere il segnale che stiamo trattando come esempio e che in precedenza abbiamo avuto già 4 operazioni in Stop con la SIGMA nell'intervallo 2-3. Poiché il numero massimo di operazioni consecutive in Stop è 3,8 la probabilità che anche questa fallisca è molto piccola. Potrei, quindi, usare un Money Management più aggressivo.

Tabella 1 INDICI Probabilità per segnali LONG in funzione della variabile sigma che si verifichino alcune condizioni.

Sigma	*EP OK*	*TPEXT*	*Stop*	*Stop Cons*
0-1	80,76%	49,26%	34,50%	7,0
1-2	83,34%	33,51%	22,13%	5,6
2-3	80,76%	30,21%	17,19%	3,8
>=3	82,10%	25,43%	13,47%	2,8

Tabella 2 INDICI Probabilità per segnali SHORT in funzione della variabile sigma che si verifichino alcune condizioni.

Sigma	*EP OK*	*TPEXT*	*Stop*	*Stop Cons*
0-1	80,21%	54,58%	39,57%	6,2
1-2	83,52%	38,63%	26,08%	6,2

2-3	84,31%	31,55%	15,44%	3,0
>=3	85,51%	27,58%	12,42%	3,3

Tabella 3Azioni Probabilità per segnali LONG in funzione della variabile sigma che si verifichino alcune condizioni.

Sigma	*EP OK*	*TPEXT*	*Stop*	*Stop Cons*
0-1	76,92%	60,46%	39,91%	4,00
1-2	77,72%	48,25%	29,08%	5,29
2-3	79,67%	39,02%	23,04%	4,86
>=3	79,54%	29,05%	14,69%	3,29

Tabella 4Azioni Probabilità per segnali SHORT in funzione della variabile sigma che si verifichino alcune condizioni.

Sigma	*EP OK*	*TPEXT*	*Stop*	*Stop Cons*
0-1	84,92%	58,17%	37,33%	3,71
1-2	82,82%	48,61%	30,03%	4,57
2-3	83,44%	39,18%	22,83%	4,86
>=3	84,90%	30,89%	16,01%	3,43

Come vengono individuate ogni sera le operazioni per il giorno dopo?

In Figura 1, Figura 2 e Figura 3 sono mostrati i titoli selezionati alla chiusura del 18 ottobre per operare in apertura del 21 ottobre. Ciascuna figura riporta il valore del TP90, TP70 e TPEXT, la tipologia di operatività (LONG o SHORT) e il valore della variabile Sigma.

Il titolo ENEL ha chiuso la giornata di contrattazione del 18 ottobre a 6,768.

Per capire come utilizzare queste informazioni concentriamo sul titolo ENEL. I valori che si ottengono da Figura 1, Figura 2 e Figura 3 sono

-200.006,734

-200.006,703

-200.006,672

Nome	Target Price
ENEL	-200.006,734
LEONARDO	-1.000
MEDIASET S.P.A	200.002,672
TELECOM ITALIA	-200.000,5312

Figura 1 Titoli selezionati per la seduta del 21 ottobre con indicazione del valore della sigma e del TP90.

Nome	Target Price
ENEL	-200.006,703
LEONARDO	-400.010,156
MEDIASET S.P.A	200.002,672
TELECOM ITALIA	-200.000,5312

Figura 2Titoli selezionati per la seduta del 21 ottobre con indicazione del valore della sigma e del TP70.

Nome	Target Price
ENEL	-200.006,672
LEONARDO	-400.010,031
MEDIASET S.P.A	200.002,703
TELECOM ITALIA	-200.000,5312

Figura 3 Titoli selezionati per la seduta del 21 ottobre con indicazione del valore della sigma e del TPEXT.

Incominciamo a spiegare il significato del segno -. Vuol dire che l'operazione da fare è SHORT (se fosse stato + l'operazione sarebbe stata LONG).

Il valore numero può essere scomposto in 200.000 + 6,734; 200.000 + 6,703 e 200.000 + 6,672.

200.000 vuol dire che il valore della SIGMA è 2, mentre gli altri valori rappresentano i TP90 (6,734),TP70 (6,703) e TPEXT (6,672).

Ecco l'operazione da fare:

Short da xxxxx o a valori inferiori/superiori con Stop a xxxxx e Take Profit a 6,734 oppure 6,703 oppure 6,672.
Se non scatta lo Stop o il Take Profit che si è deciso di attuare l'operazione verrà chiusa 5 minuti prima del time frame giornaliero.

Cosa significa valori superiori?

Se ad esempio abbiamo stabilito Short da 10 ma il titolo apre a 11 l'ingresso avverrà automaticamente a 11.

Le statistiche alla base dell'operazione da effettuare

Poiché conosciamo la SIGMA possiamo andare a vedere le probabilità di successo dell'operazione dalle tabelle corrispondenti.

Utilizzando i valori in Tabella 4 otteniamo che

Tabella 5Azioni Probabilità per segnali SHORT in funzione della variabile sigma che si verifichino alcune condizioni.

Sigma	*EP OK*	*TPEXT*	*Stop*	*Stop Cons*
0-1	84,92%	58,17%	37,33%	3,71
1-2	82,82%	48,61%	30,03%	4,57
2-3	83,44%	39,18%	22,83%	4,86
>=3	84,90%	30,89%	16,01%	3,43

La probabilità che venga raggiunto l'entry point è dell'82,82%

La probabilità che venga raggiunto TPEXT è del 48,61%

La probabilità che venga raggiunto lo Stop è del 30,03%.

Quanto scritto in questo esempio vale anche per gli indici e per le operazioni LONG.

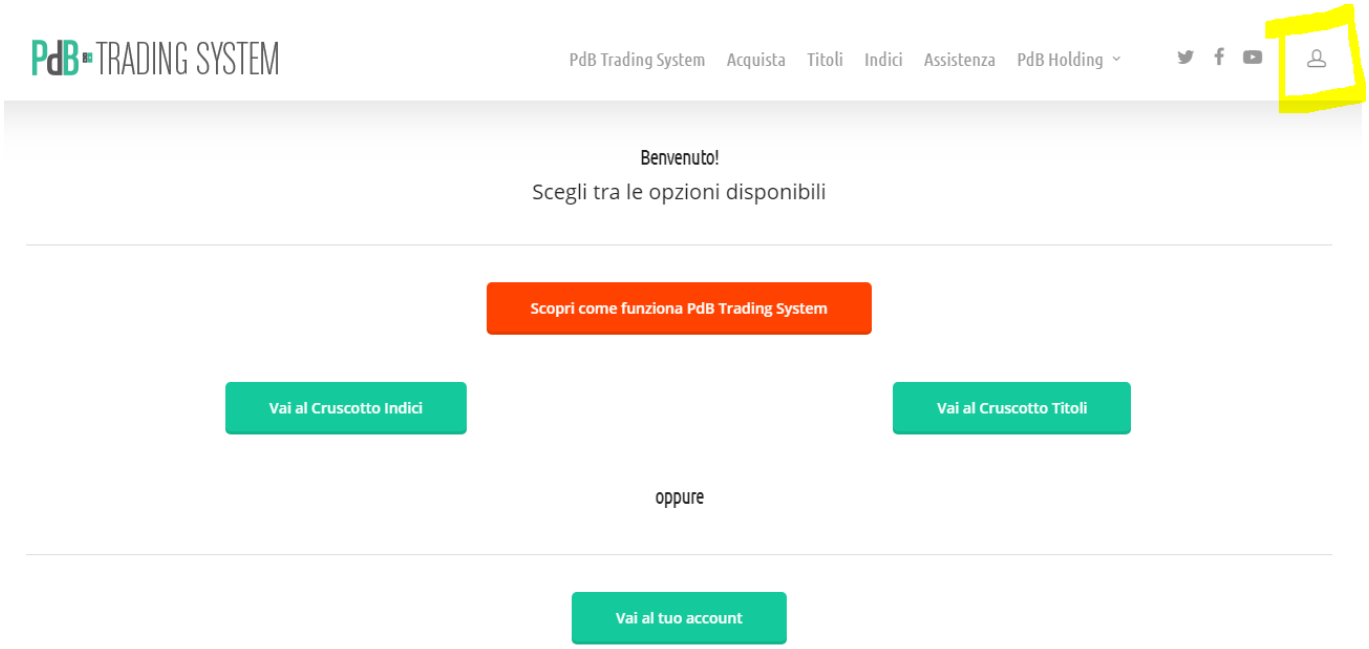
Prima di concludere facciamo notare come nel caso di Leonardo TP90 sia -1000. Trattasi di un evento raro, ma che può capitare soprattutto per TP90, per cui il prezzo obiettivo è al di sotto/al di sopra del punto di ingresso nelle operazioni LONG/SHORT. In questo caso il TP90 non si può utilizzare.

Quindi, ogni volta che troverete -1000/+1000 il TP90 non si può utilizzare ma bisogna lavorare con le altre probabilità.

Cosa dovranno fare ogni sera gli utenti registrati al servizio?

Con la USERID E PASSWORD scelti durante la fase di acquisto del servizio è sufficiente accedere al sito https://www.thecalculator.it/e cliccare su “Accesso”

Una volta eseguito l’accesso, l’utente si troverà nella seguente pagina in cui poter scegliere varie opzioni.



In qualsiasi momento sarà possibile alla propria “Area utente” cliccando sul simbolo user in alto a destra.

Nelle sezioni apposite gli utenti potranno visualizzare:

Tabella con i dati di quotazione del giorno precedente e poi per i principali indici e i principali titoli del listino milanese gli utenti riceveranno le tabelle come mostrato in precedenza inFigura 1, Figura 2 e Figura 3 con l'elenco degli strumenti sui quali operare e i rispettivi target price (TP90, TP70 e TPEXT).

Con l'aiuto delle statistiche riportate in questo ebook sarà possibile costruirsi l'operazione sullo strumento che si desidera con le probabilità a favore.

Conclusioni

Da oggi in poi fare trading non lascerà nulla al caso.

Ad Maiora

Appendice 1

Tabella 6 INDICI Probabilità per segnali LONG in funzione della variabile sigma che si verifichino alcune condizioni.

	Sigma	*EP OK*	*TPEXT*	*Stop*	*Stop Cons*
FIB	0-1	80,91%	45,45%	38,78%	5
	1-2	79,66%	40,30%	29,03%	8
	2-3	79,10%	31,09%	19,64%	4
	>=3	82,45%	28,81%	16,80%	4
BUND	0-1	83,43%	39,18%	23,78%	6
	1-2	89,39%	21,70%	11,85%	3
	2-3	73,91%	27,27%	8,00%	1
	>=3	-	-	-	
Eurostoxx	0-1	84,26%	53,70%	42,86%	8
	1-2	82,08%	38,93%	28,14%	7
	2-3	83,98%	36,07%	29,43%	7
	>=3	81,95%	25,63%	18,41%	4
DAX	0-1	80,19%	55,77%	34,70%	6
	1-2	82,50%	36,23%	23,93%	5
	2-3	81,46%	29,43%	17,28%	4
	>=3	81,74%	25,22%	11,20%	2
SP500	0-1	75,02%	52,22%	32,37%	10
	1-2	83,06%	30,40%	17,72%	5
	2-3	85,34%	27,20%	11,60%	3
	>=3	82,26%	22,04%	7,46%	1

Tabella 7 INDICI Probabilità per segnali SHORT in funzione della variabile sigma che si verifichino alcune condizioni.

	Sigma	*EP OK*	*TPEXT*	*Stop*	*Stop Cons*
FIB	0-1	85,37%	62,65%	48,75%	6
	1-2	79,19%	47,43%	36,98%	5
	2-3	80,34%	38,01%	21,40%	3
	>=3	83,83%	31,54%	14,71%	3
BUND	0-1	85,93%	38,85%	28,91%	6
	1-2	89,56%	20,70%	10,89%	3
	2-3	87,50%	20,45%	2,04%	1
	>=3	-		-	
Eurostoxx	0-1	73,08%	61,54%	40,00%	5
	1-2	82,10%	49,36%	31,88%	11
	2-3	83,98%	37,83%	24,85%	6
	>=3	86,68%	30,01%	16,49%	5
DAX	0-1	81,77%	56,25%	43,20%	7
	1-2	81,93%	43,00%	29,66%	7
	2-3	83,54%	34,78%	15,54%	3
	>=3	87,00%	21,77%	8,88%	

SP500	0-1	74,89%	53,59%	36,99%	7
	1-2	84,83%	32,65%	21,00%	5
	2-3	86,21%	26,68%	13,38%	2
	>=3	84,51%	26,99%	9,60%	2

Tabella 8 Azioni Probabilità per segnali LONG in funzione della variabile sigma che si verifichino alcune condizioni.

	Sigma	*EP OK*	*TPEXT*	*Stop*	*Stop Cons*
ENI	0-1	72,92%	64,95%	45,45%	6
	1-2	77,98%	47,55%	25,84%	5
	2-3	80,59%	31,92%	19,61%	5
	>=3	78,43%	24,61%	14,37%	3
INTESA	0-1	73,08%	61,54%	39,53%	3
	1-2	75,45%	51,82%	31,54%	5
	2-3	83,09%	37,68%	25,67%	6
	>=3	80,19%	29,62%	17,04%	3
TELECOM	0-1	76,32%	55,26%	37,70%	3
	1-2	73,78%	49,71%	32,36%	5
	2-3	77,20%	42,35%	20,63%	4
	>=3	75,16%	33,19%	14,69%	3
UNICREDIT	0-1	81,36%	49,15%	41,58%	6
	1-2	75,57%	50,89%	28,93%	5
	2-3	78,69%	43,87%	23,94%	5
	>=3	76,08%	32,58%	14,00%	3
FCA	0-1	63,64%	69,18%	43,59%	4
	1-2	75,93%	53,28%	29,92%	5
	2-3	72,62%	46,34%	24,78%	8
	>=3	76,90%	33,64%	15,67%	5
Atlantia	0-1	77,78%	59,82%	30,36%	3
	1-2	82,52%	39,55%	24,54%	6
	2-3	83,26%	30,51%	17,05%	2
	>=3	86,67%	18,85%	12,30%	2
Banco BPM	0-1	93,33%	63,33%	41,18%	3
	1-2	82,81%	44,92%	30,43%	6
	2-3	82,24%	40,50%	29,60%	4
	>=3	83,37%	30,85%	14,76%	4
Buzzi Unicem	0-1	86,96%	65,22%	39,47%	3
	1-2	80,25%	51,85%	31,36%	4
	2-3	81,86%	37,83%	23,00%	4
	>=3	-	-	-	4

Tabella 9 Azioni Probabilità per segnali SHORT in funzione della variabile sigma che si verifichino alcune condizioni.

	Sigma	*EP OK*	*TPEXT*	*Stop*	*Stop Cons*
ENI	0-1	81,82%	66,23%	41,67%	4
	1-2	79,20%	48,21%	30,58%	5
	2-3	83,21%	32,77%	22,43%	4
	>=3	83,37%	28,82%	16,79%	4
INTESA	0-1	75,00%	70,83%	40,00%	5
	1-2	83,08%	52,76%	31,29%	4
	2-3	82,87%	41,54%	22,81%	6

	>=3	85,57%	29,62%	17,04%	3
TELECOM	0-1	82,50%	60,00%	29,82%	3
	1-2	82,29%	52,92%	28,55%	4
	2-3	80,00%	41,63%	22,15%	5
	>=3	82,16%	33,24%	14,81%	3
UNICREDIT	0-1	88,10%	47,61%	40,00%	3
	1-2	77,42%	50,62%	29,05%	4
	2-3	83,63%	40,22%	22,88%	4
	>=3	83,90%	34,54%	16,53%	4
FCA	0-1	86,96%	69,57%	48,89%	4
	1-2	82,95%	52,79%	35,99%	6
	2-3	80,29%	40,68%	24,18%	4
	>=3	83,43%	32,10%	16,39%	4
Atlantia	0-1	85,34%	50,86%	36,96%	4
	1-2	86,70%	39,55%	27,99%	4
	2-3	88,06%	33,33%	20,71%	6
	>=3	87,35%	25,30%	16,12%	3
Banco BPM	0-1	94,74%	42,10%	24,00%	3
	1-2	88,13%	43,44%	26,77%	5
	2-3	86,02%	44,06%	24,65%	5
	>=3	88,55%	32,63%	14,42%	3
Buzzi Unicem	0-1	66,67%	66,67%	54,55%	4
	1-2	83,39%	56,54%	34,64%	7
	2-3	84,75%	40,00%	26,02%	3
	>=3				3