

ANALISI LIVELLI DI PREZZO per FUTURES/CFD/VALUTE FOREX

Durata media op.ni T.F. DAILY:8

Durata media op.ni T.F. SETT.LE32

Rating medio

2,9

Lapidari.it

Elaborazioni e studi validi per OGGI: 27/10/2021


Queste pagine di analisi non costituiscono servizio di consulenza finanziaria personalizzata né sollecitazione al pubblico risparmio. Queste indicazioni sono elaborate a scopo informativo, con natura di informativa tecnica, e non sono necessariamente un valido supporto previsionale sull'andamento futuro degli strumenti finanziari analizzati. Gli spunti proposti sono basati su un modello tecnico-grafico e non possono in alcun modo sostituire il libero ed informato giudizio dell'investitore, che agisce a proprio rischio e pericolo. Per altre info cliccare su <https://lapidari.it/disclaimer>

In GIALLO e in CELESTE i valori massimi e minimi di RATING e Profit/Loss.

DATI ESSENZIALI			INTRADAY				T.S. a breve/medio termine						gg durata minima op.ni		2		T.S. a medio/lungo termine						gg durata minima op.ni		10	
													gg durata massima op.ni		20								gg durata massima op.ni		45	
STRUMENTO	CLOSE IERI	Rating	T.S. INTRADA Y	PREZZO	TARGET	STOP	T.S. DAILY	Da quante sedute?	STRATEGIA	PREZZO INIZIALE	TARGET	STOP TRAILING	P/L in %	T.S. SETT	Da quante settimane?	STRATEGIA	PREZZO INIZIALE	TARGET	STOP TRAILING	P/L in %						
DAX	15.721	3,7	LONG	15.732	15.807	15.676	LONG	11	Resto Long	15.145	15.836	15.459	3,8%	LONG	2	Resto Long	15.220	16.048	14.449	3,3%						
EURO50	4.204	3,7	LONG	4.185	4.207	4.169	LONG	10	Resto Long	4.046	4.236	4.146	3,9%	LONG	2	Resto Long	3.885	4.328	3.499	8,2%						
FTSEMIB40	26.765	4,0	LONG	26.825	26.953	26.729	LONG	11	Resto Long	25.642	26.989	26.383	4,4%	LONG	5	Resto Long	25.623	27.273	25.449	4,5%						
SP500	4.565,3	3,8	LONG	4.578	4.600	4.562	LONG	9	Resto Long	4.376	4.595	4.520	4,3%	LONG	5	Resto Long	4.431	4.679	4.322	3,0%						
NASDAQ	15.545,0	3,8	LONG	15.622	15.718	15.550	LONG	9	Resto Long	14.826	15.713	15.307	4,9%	LONG	3	Resto Long	14.847	15.886	14.583	4,7%						
DOWJONES	35.644	3,8	LONG	35.713	35.872	35.594	LONG	10	Resto Long	34.328	35.832	35.411	3,8%	LONG	5	Resto Long	34.541	36.628	34.131	3,2%						
RUSSELL	2.293,9	2,6	LONG	2.296,5	2.312,6	2.284,5	LONG	6	Resto Long	2.265,8	2.322,8	2.282,0	1,2%	LONG	5	Resto Long	2.228,8	2.375,0	2.199,0	2,9%						
BUND	168,69	2,8	LONG	168,60	168,94	168,34	LONG	Da oggi	APRO LONG	168,38	169,39	167,52		SHORT	9	Resto Short	176,49	167,65	169,99	4,6%						
BTP	151,00	2,5	LONG	151,27	151,63	151,00	LONG	Da oggi	APRO LONG	150,92	151,99	150,08		SHORT	Da questa	APRO SHORT	151,35	149,30	153,25	0,0%						
TBOND	158,97	1,7	LONG	158,57	159,14	158,15	LONG	2	Resto Long	158,18	159,72	156,72	0,5%	SHORT	8	Resto Short	163,99	155,87	160,97	3,2%						
ORO	1.792,7	2,3	LONG	1.806,8	1.816,4	1.799,6	LONG	Da oggi	APRO LONG	1.799,2	1.826,4	1.769,99		LONG	3	Resto Long	1.752,1	1.833,8	1.743,7	2,3%						
RAME	448,60	3,7	SHORT	451,60	445,32	456,31	SHORT	3	Resto Short	463,77	438,0	467,89	3,4%	LONG	3	Resto Long	424,28	459,3	440,14	5,7%						
PETROLIO	84,65	2,8	LONG	84,61	85,60	83,86	LONG	4	Resto Long	82,67	86,01	81,39	2,4%	LONG	9	Resto Long	66,23	87,36	78,62	27,8%						
BITCOIN	60.477	2,7	LONG	61.246	62.715	60.145	LONG	Da oggi	APRO LONG	62.454	66.259	57.322		LONG	4	Resto Long	45.356	69.748	51.093	33,3%						
EURO USD	1,1595	2,6	SHORT	1,1592	1,1570	1,1609	SHORT	2	Resto Short	1,1625	1,1551	1,1689	0,3%	LONG	Da questa	APRO LONG	1,1606	1,1746	1,1474	0,0%						
EURO YEN	132,32	2,1	LONG	132,30	132,65	132,03	LONG	Da oggi	APRO LONG	132,35	133,09	131,43		LONG	3	Resto Long	129,51	133,98	130,06	2,2%						
USD YEN	114,14	2,6	LONG	114,16	114,45	113,95	LONG	2	Resto Long	113,79	114,73	112,95	0,3%	LONG	8	Resto Long	109,88	114,95	112,38	3,9%						
EURO GBP	0,8419	2,1	SHORT	0,8410	0,8392	0,8424	SHORT	2	Resto Short	0,8437	0,8385	0,8481	0,2%	SHORT	4	Resto Short	0,8566	0,8382	0,8512	1,7%						
GBP USD	1,3766	1,5	SHORT	1,3760	1,3724	1,3787	SHORT	3	Resto Short	1,3779	1,3702	1,3817	0,1%	LONG	3	Resto Long	1,3585	1,3916	1,3587	1,3%						
EURO CHF	1,0666	3,3	SHORT	1,0667	1,0649	1,0681	SHORT	20	Resto Short	1,0839	1,0627	1,0710	1,6%	SHORT	5	Resto Short	1,0868	1,0577	1,0767	1,9%						
USD CHF	0,9201	3,3	LONG	0,9212	0,9235	0,9195	LONG	2	Resto Long	0,9180	0,9243	0,9127	0,2%	SHORT	3	Resto Short	0,9289	0,9054	0,9299	1,0%						
USD CAD	1,2388	3,3	LONG	1,2388	1,2421	1,2362	LONG	4	Resto Long	1,2354	1,2450	1,2328	0,3%	SHORT	5	Resto Short	1,2687	1,2197	1,2518	2,4%						
AUD USD	0,7499	1,8	LONG	0,7490	0,7516	0,7470	LONG	2	Resto Long	0,7487	0,7548	0,7411	0,2%	LONG	3	Resto Long	0,7272	0,7585	0,7278	3,1%						
NZD USD	0,7173	2,1	LONG	0,7156	0,7183	0,7136	LONG	2	Resto Long	0,7163	0,7225	0,7087	0,1%	LONG	2	Resto Long	0,6982	0,7287	0,6800	2,7%						
			SEGNALI INTRADAY: <u>OSSERVO</u> su grafico t.f. 15/30 minuti. <u>ENTRO</u> su grafico t.f. 5/10 minuti. Per lo <u>STOP</u> , decido di USCIRE se ho chiusura di candela a 30/max 60 minuti inferiore al prezzo di stop.				SEGNALI GIORNALIERI: <u>OSSERVO</u> su grafico t.f. 2/4 ore. <u>ENTRO</u> su grafico t.f. 60 minuti. Per lo <u>STOP</u> , se ho poca tolleranza al rischio, deciderò di USCIRE se ho chiusura di candela a 2/max 4 ORE inferiore/superiore al prezzo di stop. Se ho maggiore tolleranza al rischio, attenderò la chiusura della seduta.						SEGNALI SETTIMANALI: <u>OSSERVO</u> su grafico DAILY. <u>ENTRO</u> su grafico t.f.4/6 ore. Per lo <u>STOP</u> , se ho poca tolleranza al rischio, deciderò di USCIRE se ho chiusura di candela daily, entro mercoledì, inferiore/superiore al prezzo di stop. Per lo <u>STOP</u> , se ho maggiore tolleranza al rischio, deciderò di USCIRE con chiusura di candela SETTIMANALE inferiore/superiore al prezzo di stop.													

OPERAZIONI CHE SI CHIUDERANNO OGGI

Le regole del Trading System, e le relative statistiche da esse generate, sono: le operazioni su time frame daily si possono aprire e/o chiudere ogni giorno, mentre quelle settimanali si aprono e/o si chiudono ogni lunedì. Le intraday si aprono e/o si chiudono nella seduta odierna.

	DATI ESSENZIALI		T.S. DAILY					DATI ESSENZIALI		T.S. SETTIMANALE				
	STRUMENTO	CLOSE IERI	Da quante sedute la posizione è aperta?	STRATEGIA di USCITA	PREZZO INIZIALE	STOP TRAILING	P / L TEORICO in %	STRUMENTO	CLOSE ULTIMA SETTIMANA	Da quante settimane la posizione è aperta?	STRATEGIA DI USCITA	PREZZO INIZIALE	STOP TRAILING	P / L TEORICO in %
Le operazioni che sono segnalate come CHIUDO LONG o CHIUDO SHORT ne aprono sempre una di segno contrario.	DAX	15.721						DAX	15.549					
	EURO50	4.204						EURO50	4.187					
	FTSEMIB40	26.765						FTSEMIB40	26.455					
	SP500	4.565,3						SP500	4.536,5					
Ad esempio, se il sistema segnala di CHIUDERE UN LONG SU SP500 nella seduta odierna, contemporaneamente indicherà di APRIRE UNO SHORT SU SP500.	NASDAQ	15.545						NASDAQ	15.341					
	DOWJONES	35.644						DOWJONES	35.557					
	RUSSELL	2.293,9						RUSSELL	2.288,8					
	BUND	168,69	6	CHIUDO SHORT	169,23	168,33	0,32%	BUND	168,28					
	BTP	151,00	6	CHIUDO SHORT	151,91	150,86	0,60%	BTP	150,72	1	CHIUDO LONG	151,88	151,92	-0,77%
	TBOND	158,97						TBOND	158,59					
	ORO	1.792,7	1	CHIUDO SHORT	1.787,52	1.792,03	-0,29%	ORO	1.792,3					
	RAME	448,60						RAME	449,8					
N.B.: i prezzi di apertura/chiusura di entrambe le operazioni differiscono fra loro, perchè la formula che segnala il trailing stop a cui chiudere un'operazione non è uguale a quella che calcola il prezzo di apertura. Questo criterio è valido sia per il trading system Daily che per quello Settimanale.	PETROLIO	84,65						PETROLIO	83,8					
	BITCOIN	60.477	2	CHIUDO SHORT	64.123	62.106	6,03%	BITCOIN	60.734					
	EURO USD	1,1595						EURO USD	1,1647	5	CHIUDO SHORT	1,18	1,16	1,29%
	EURO YEN	132,32	3	CHIUDO SHORT	132,88	132,20	0,43%	EURO YEN	132,15					
	USD YEN	114,14						USD YEN	113,46					
	EURO GBP	0,8419						EURO GBP	0,8467					
	GBP USD	1,3766						GBP USD	1,3751					
	EURO CHF	1,0666						EURO CHF	1,0666					
	USD CHF	0,9201						USD CHF	0,9158					
	USD CAD	1,2388						USD CAD	1,2367					
	AUD USD	0,7499						AUD USD	0,7464					
	NZD USD	0,7173						NZD USD	0,7153					

LEGENDA LIVELLI DI PREZZO

LOGICA del T.S. INTRADAY

Questa analisi fornisce livelli di prezzo intraday, validi quindi per la sola seduta di oggi.
I calcoli provengono da: Indicatore di SENTIMENT/BUY.SELL/VOLATILITA'/TENDENZA.
Questi algoritmi generano un livello di prezzo e ipotesi di tendenza rialzista/ribassista, da utilizzare DISCREZIONALMENTE da parte del singolo investitore. Vengono a loro volta indicati target e prezzi che invalidano l'ipotesi. Si suggerisce di attendere le ore di maggiore scambio per operare e di chiudere eventuali operazioni entro il termine delle contrattazioni odierne.

LOGICA del T.S. DAILY e del T.S. SETTIMANALE

Queste altre due analisi hanno l'obiettivo di individuare situazioni di mercato in tendenza.
Esse forniscono livelli di prezzo in armonia con il TREND rilevato su base giornaliera e settimanale, quindi NON IN CONTROTENDENZA.
L'obiettivo è quello fornire dati utili, da utilizzare DISCREZIONALMENTE da parte del singolo investitore, per una sua OPERATIVITA' DI POSIZIONE a MEDIO e LUNGO TERMINE. Lo schema segnala da quante sedute è stata aperta la posizione nel trading system, e il prezzo di apertura della stessa.
Viene inoltre indicato il target/obiettivo per la seduta di oggi, o per la settimana, e il livello che (se raggiunto a CHIUSURA) invaliderà il trade evidenziato.
Il prezzo di invalidazione è il medesimo valore per apertura di un'operazione di segno contrario.

ESEMPIO DEI LIVELLI DI PREZZO e LEGENDA PER MIGLIORE INTERPRETAZIONE DELLE INFORMAZIONI ELABORATE DAI TRADING SYSTEM

STRUMENTO	CLOSE IERI	Rating
DAX	15.721	4
EURO50	4.204	4
EURO USD	1,1595	3
EURO YEN	132,32	2



CLOSE IERI	E' il prezzo di chiusura della seduta precedente a quella odierna.
RATING	E' un voto, che va da 0 a 5, sulla qualità del trend, volatilità, e rapporto rischio/rendimento del segnale generato dal trading system. Il rating analizza soltanto i numeri del T.S. DAILY, non di quello su base settimanale. Suggerimento: in un TREND LONG già da alcune sedute, se oggi compare rating 1 o 2, è segno che la qualità della salita si sta deteriorando. Monitorare in quel caso il prezzo di trailing stop: c'è buona probabilità che la seduta chiuda negativa. In quel caso comparirebbe, per domani, un suggerimento SHORT, che però è consigliabile gestire con prudenza, soprattutto se accompagnato da rating modesto (1-2). Infatti, il basso rating spesso indica l'entrata in una fase meno direzionale, ma non sempre favorevole a inversioni; in simili frangenti possono generarsi pullback nuovamente rialzisti, tali da invalidare l'alert. ribassista. Al contrario, ovviamente, in fasi di ribasso in essere già da alcune sedute, seguite da alert di chiusura posizione accompagnato da rating 1-2.

T.S. INTRADAY

STRATEGIA INTRADAY	PREZZO	TARGET	STOP
LONG	15.732	15.807	15.676
LONG	4.185	4.207	4.169
SHORT	1,1592	1,1570	1,1609
LONG	132,30	132,65	132,03

STRATEGIA INTRADAY	Il Trading System suggerisce impostazione rialzista del segnale (long) o ribassista (short). Per il T.S. INTRADAY il segnale è valido solo per la seduta odierna, e quindi avremo unicamente indicazioni di prezzo di entrata, target e stop.
PREZZO	E' il prezzo suggerito per aprire una posizione. La sessione notturna dei mercati può invalidare questo prezzo; non è infrequente il caso di bruschi movimenti di prezzo già a partire dalla sessione notturna. Le statistiche dei sistemi, se il prezzo di apertura di posizione è, rispettivamente, inferiore ai minimi di seduta in caso di operazione rialzista, e superiore ai massimi di seduta in caso di operazione ribassista, considerano come prezzo utile l'apertura della seduta. Attenzione pertanto alle aperture in forte gap: il più delle volte, almeno nella prima parte della giornata, vi è incremento di tendenza nella direzione del gap (rialzo se gap up, ribasso se gap down). Si suggerisce di non avere fretta di entrare in posizione, attendendo le ore 10 del mattino sia per gli indici azionari, che per gli strumenti che scambiano anche durante la notte, quali ad esempio le valute forex, i futures e cfd su indici esteri e materie prime, ecc. ecc.).
TARGET	E' l'obiettivi di prezzo generato dal trading system. Spesso corrisponde a una resistenza, se siamo in presenza di operazione a rialzo, e al contrario ad un supporto in caso di operazione a ribasso.
STOP	E' il prezzo che invalida l'ipotesi operativa generata dal trading system. Nota tecnica: molti investitori adoperano questi tre valori (prezzo iniziale/target/stop) per impostare discrezionalmente operazioni in controtendenza o in modalità stop and reverse. Si suggerisce di adottare la massima prudenza in casi del genere, che sono riservati a operatori esperti.

T.S. DAILY e SETTIMANALE



T.S. DAILY	Da quante sedute?	STRATEGIA	PREZZO INIZIALE	TARGET	STOP TRAILING
LONG	11	Resto Long	15.145	15.836	15.459
LONG	10	Resto Long	4.046	4.236	4.146
SHORT	2	Resto Short	1,1625	1,1551	1,1689
LONG	Da oggi	APRO LONG	132,35	133,09	131,43

T.S. SETT.LE	Da quante settimane?	STRATEGIA	PREZZO INIZIALE	TARGET	STOP TRAILING
LONG	2	Resto Long	15.220	16.048	14.449
LONG	2	Resto Long	3.885	4.328	3.499
LONG	Da questa	APRO LONG	1,1606	1,1746	1,1474
LONG	3	Resto Long	129,51	133,98	130,06

DA QUANTE SEDUTE/SETTIMANE?

Viene indicato da quante sedute/settimane i due Trading Systems, che operano su time frame daily e settimanale, hanno generato il segnale Long/Short. Il T.S. daily elabora i suoi calcoli a chiusura dell'ultima seduta, mentre quello su base settimanale esegue e aggiorna i suoi calcoli nel weekend, e presenta i suoi livelli di prezzo il lunedì successivo. In questo caso tali indicazioni e prezzi resteranno validi per tutta le sedute da lunedì a venerdì compreso. Esempio: chiusura settimanale venerdì 15/1/2021, prezzi presentati lunedì 18/1 e validi per la settimana che va dal 18/1 al 22/1/2021. Per il T.S. DAILY il segnale può avere luogo a partire da questa seduta. In tal caso, nella colonna denominata DA QUANTE SEDUTE?, avremo l'indicazione "Da oggi". Sul T.S. settimanale, la dicitura "Da oggi" diventa "Da questa". Se invece il segnale è già in essere dalle sedute precedenti, verrà riportato il numero di sedute/settimane consecutive quando si è generato il segnale.

STRATEGIA

Per strategia si intende il tipo di segnale rilevato dai TS, sia su base daily che settimanale. Quando i T.S. rilevano che la direzione del sottostante analizzato è mutata, emergono gli alert di cui sopra.

- **APRI LONG / CHIUDI SHORT:** Il sistema chiude un segnale di ribasso, a prescindere che sia attivo dal giorno/settimana precedente oppure da più tempo, e suggerisce un'operatività di segno opposto.
- **APRI SHORT / CHIUDI LONG:** Il sistema chiude un segnale rialzista, a prescindere che sia attivo dal giorno/settimana precedente oppure da più tempo, e suggerisce un'operatività di segno opposto.
- **RESTA LONG / RESTA SHORT:** la dicitura sta a significare che l'ipotesi rialzista o ribassista, emersa nelle precedenti sedute/settimane, è ancora valida.

Le fasi di mercato tendenziale sono le più adatte alle strategie di questi due sistemi, poiché essi si basano su regole trend following. Nei momenti di mercato laterale la scarsa direzione, e le oscillazioni fra zone di supporto e resistenza, diminuisce l'efficacia dei sistemi che operano in favore di tendenza. In caso di "falso segnale", le formule di stop e trailing adottate permettono comunque di registrare perdite contenute.

PREZZO INIZIALE

E' il prezzo suggerito per aprire una posizione. La sessione notturna dei mercati internazionali può invalidare questo valore, creando quindi le condizioni - soprattutto sui mercati europei - per un'apertura ribassista, nei pressi/sotto ai minimi di ieri, seguita poi da un rimbalzo, o apertura nei pressi/sopra i massimi di ieri, seguita poi da un ribasso.

Le statistiche dei sistemi, se il prezzo di apertura di posizione è inferiore ai minimi di seduta in caso di operazione rialzista, e superiore ai massimi di seduta in caso di operazione ribassista, considerano come segnale il prezzo di apertura della seduta.

Attenzione pertanto alle aperture in forte gap: il più delle volte, almeno nella prima parte della giornata, la tendenza prosegue nella direzione del gap (rialzo se gap up, ribasso se gap down).

Si suggerisce quindi di non avere fretta di entrare in posizione, attendendo le ore 10 del mattino sia per gli indici azionari, che per gli strumenti che scambiano anche durante la notte, quali ad esempio le valute forex, i futures e cfd su indici esteri e materie prime, ecc. ecc.).

NOTA BENE: IL PREZZO INIZIALE E' QUELLO DELL'APERTURA DI POSIZIONE DA PARTE DEL TRADING SYSTEM, SIA SU DATI GIORNALIERI CHE SETTIMANALI.

PERTANTO, ESSO NON SI MODIFICHERA' SE L'OPERAZIONE DESCRITTA NEL REPORT RESTA APERTA. E' QUINDI DA INTENDERSI UN SEMPLICE SEGNALE CHE INDICA DA CHE PREZZO IL SISTEMA E' A RIALZO O A RIBASSO.

TARGET

E' il prezzo/obiettivo calcolato dai T.S.; per le operazioni che seguono la tendenza (quelle accompagnate da strategia Resta Long/Resta Short), questo prezzo si adegua su base giornaliera/settimanale.

STOP TRAILING

E' il prezzo che invalida l'ipotesi suggerita dai TS. Per le operazioni che seguono la tendenza (quelle accompagnate da strategia Resta Long/Resta Short), questo prezzo si adegua su base giornaliera/settimanale.

IMPORTANTE: Il prezzo di stop/trailing stop è monitorato PRINCIPALMENTE da quel tipo di INVESTITORE "ATTIVO" CHE SEGUE QUOTIDIANAMENTE I PREZZI DI MERCATO, e che pertanto decide discrezionalmente entrata e gestione della posizione. Di solito, vi è BASSA/MEDIA TOLLERANZA AL RISCHIO, e ciò giustifica l'uso del trailing/stop per adeguare l'operatività personale.

In realtà, statisticamente il modo migliore per ottenere risultati da un trading system è quello di restare in posizione fino a quando non cambia il segnale. Il più delle volte, ciò evita di chiudere prematuramente una posizione aperta con logica di medio/lungo periodo, poiché spesso avviene che il prezzo di chiusura (che è quello che convalida o meno il trend in essere) confermi il mantenimento della STRATEGIA LONG/SHORT, indipendentemente dal fatto che il Trading System stia o meno generando un utile. Del resto, l'esperienza discrezionale di ognuno di noi avvalora questa strategia; infatti, quante volte le migliori operazioni hanno però tentennato per numerose sedute prima di prendere la direzione auspicata?

Nota tecnica: molti investitori adoperano questi tre valori (prezzo iniziale/target/stop) per impostare discrezionalmente operazioni in controtendenza o in modalità stop and reverse, e anche più di un trader usa sia i prezzi di entrata che quelli di stop/trailing stop per eventual nuovi ingressi in posizione, soprattutto quando il Trading System ha generato il segnale nelle precedenti sedute.

Si suggerisce di adottare la massima prudenza in casi del genere, che sono riservati a operatori esperti.