

# ANALISI LIVELLI DI PREZZO per FUTURES/CFD/VALUTE FOREX

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>

## DATI ESSENZIALI

STRUMENTO	CLOSE IERI	Rating
DAX	15.721	3,7
EURO50	4.204	3,7
FTSEMIB40	26.765	4,0
SP500	4.565,3	3,8
NASDAQ	15.545,0	3,8
DOWJONES	35.644	3,8
EURO USD	1,1595	2,6
EURO YEN	132,32	2,1
USD YEN	114,14	2,6
EURO GBP	0,8419	2,1
GBP USD	1,3766	1,5
USD CAD	1,2388	3,3

## INTRADAY

T.S. INTRADAY	PREZZO	TARGET	STOP
LONG	15.732	15.807	15.676
LONG	4.185	4.207	4.169
LONG	26.825	26.953	26.729
LONG	4.578	4.600	4.562
LONG	15.622	15.718	15.550
LONG	35.713	35.872	35.594
SHORT	1,1592	1,1570	1,1609
LONG	132,30	132,65	132,03
LONG	114,16	114,45	113,95
SHORT	0,8410	0,8392	0,8424
SHORT	1,3760	1,3724	1,3787
LONG	1,2388	1,2421	1,2362

## TIME FRAME DAILY

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
LONG	11	Resto Long	25.642	26.989	26.383
LONG	9	Resto Long	4.376	4.595	4.520
LONG	9	Resto Long	14.826	15.713	15.307
LONG	10	Resto Long	34.328	35.832	35.411
SHORT	2	Resto Short	1,1625	1,1551	1,1689
LONG	Da oggi	APRO LONG	132,35	133,09	131,43
LONG	2	Resto Long	113,79	114,73	112,95
SHORT	2	Resto Short	0,8437	0,8385	0,8481
SHORT	3	Resto Short	1,3779	1,3702	1,3817
LONG	4	Resto Long	1,2354	1,2450	1,2328

## TIME FRAME SETTIMANALE

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	5	Resto Long	25.623	27.273	25.449
LONG	5	Resto Long	4.431	4.679	4.322
LONG	3	Resto Long	14.847	15.886	14.583
LONG	5	Resto Long	34.541	36.628	34.131
LONG	Da questa	APRO LONG	1,1606	1,1746	1,1474
LONG	3	Resto Long	129,51	133,98	130,06
LONG	8	Resto Long	109,88	114,95	112,38
SHORT	4	Resto Short	0,8566	0,8382	0,8512
LONG	3	Resto Long	1,3585	1,3916	1,3587
SHORT	5	Resto Short	1,2687	1,2197	1,2518

## 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 sistemi generano livelli di prezzo e ipotesi di tendenza rialzista/ribassista, da utilizzare DISCREZIONALMENTE da parte dell'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 dell'investitore, per una sua OPERATIVITA' DI POSIZIONE a MEDIO-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 le varie sedute/settimane, e il livello che può invalidare l'operazione, qualora venga rotto in chiusura (e non soltanto DURANTE la seduta).

## T.S. INTRADAY

STRUMENTO	STRATEGIA INTRADAY	PREZZO	TARGET	STOP
DAX	LONG	15.732	15.807	15.676
EURO50	LONG	4.185	4.207	4.169
EURO USD	SHORT	1,1592	1,1570	1,1609
EURO YEN	LONG	132,30	132,65	132,03

**NOTE SUL 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.

STRATEGIA	Il Trading System suggerisce impostazione rialzista del segnale (long) o ribassista (short). L'impostazione è valida solo per la seduta odierna.
PREZZO	E' il prezzo suggerito per aprire una posizione. La sessione notturna dei mercati può invalidare questo valore, dato che non è infrequente il caso di bruschi movimenti di prezzo già a partire dalla mezzanotte. Le statistiche dei sistemi, se il prezzo di apertura di posizione viene superato dai movimenti notturni, considerano come prezzo utile l'apertura della seduta. <b>Attenzione pertanto alle aperture in forte gap:</b> 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 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.
TARGET	E' l'obiettivo di prezzo generato dal trading system. Spesso corrisponde a una resistenza, se rialzo, e a un supporto se ribasso.
STOP	E' il prezzo che invalida l'ipotesi operativa generata dal trading system. Nota tecnica: molti investitori adoperano il prezzo di 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, le 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 da 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 una 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 già aperte - quelle accompagnate da strategia Resto Long/Resto 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 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 avvalorava 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.