

Milano, 23 e 24 ottobre 2019

Trading Online Expo



UNA STRATEGIA SUL FTSE MIB (FIB)

LUCA GIUSTI



RISK DISCLOSURE E PROTEZIONE DEL MATERIALE

Il trading su strumenti derivati (Futures, Forex, Opzioni, CFD) così come il trading a margine su Azioni, può comportare il rischio di perdite e non è adatto a tutti gli investitori. L'elevato grado di leva finanziaria può funzionare a vostro svantaggio ma anche a vostro vantaggio. Esiste la possibilità di subire la perdita di parte o di tutto l'investimento iniziale e pertanto non si dovrebbe investire denaro che non ci si può permettere di perdere. QTLab, il docente e gli altri membro dello staff non possono essere ritenuti in alcun modo responsabili di perdite derivanti dall'attività di trading del partecipante.

Tutto il Materiale presentato in questo corso (slide, documenti pdf, excel, codici easy language, workspace...) è protetto dal diritto d'autore e si concede al partecipante di farne un utilizzo strettamente personale, accettando di non condividerlo con altre persone e di non impiegarlo a fini commerciali di alcun genere.

La sua presenza in sala (o la sua presenza collegato a distanza) implica l'accettazione di queste condizioni.



LUCA GIUSTI

- Trader Discrezionale (Opzioni) dal 2002
- Trader Sistemático (Opzioni e Futures) dal 2011
- QTLab in Svizzera (attività di Ricerca e Formazione)
- Da Vinci Fintech (sviluppo Piattaforme)
- Autore libro «Trading Meccanico» (Hoepli, 2015)
- Socio Professionale, docente al Master SIAT e Membro Comitato Scientifico di SIAT
- Relatore convegni internazionali (*IFTA2017, a Londra per CME e per la MasterClass di Tradestation, a Dubai per TradeStation*) e in Italia (*ITForum, TOL Expo, Investing*)





...Sviluppiamo **Metodologie di Trading**

...le **impieghiamo** sui nostri conti

...pubblichiamo le nostre Operazioni

...le **insegniamo** nei Corsi di Formazione

...e così finanziamo l'**attività di Ricerca...**



FTSE MIB FUTURE (FIB)



5 € a punto

Min Movement: 5 punti

1 Tick = 25 €

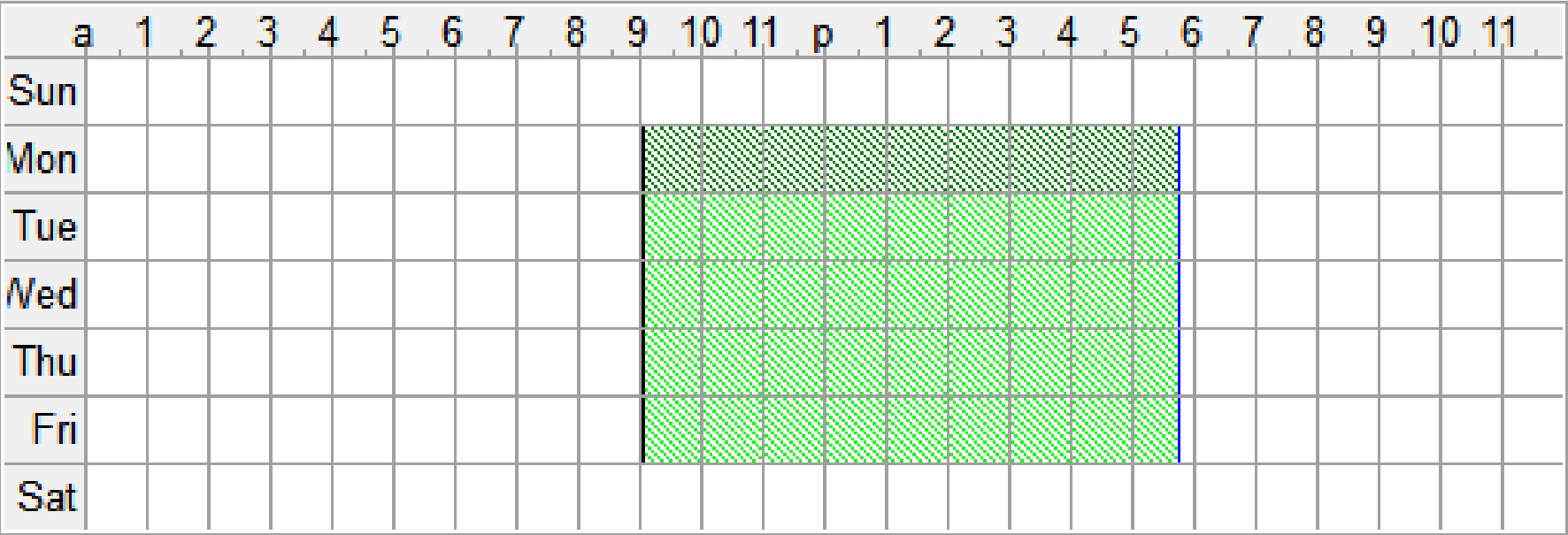
Slippage: 30-40 €

FIB				
Dal 1-gen-	(CTRL) ▾	-nov-2000	: 9:30 - 17:30	
Dal 1-dic-2001	al 30-giu-2003	: 9:30 - 17:40		
Dal 1-lug-2003	al 20-nov-2015	: 9:00 - 17:40		
Dal 23-nov-2015	al 30-giu-2017	: 9:00 - 17:50		
Dal 03-lug-2017	ad oggi	: 9:00 - 20:30		

Session

FIB

dal 01-07-2003 ad oggi



Regular



Outside Regular

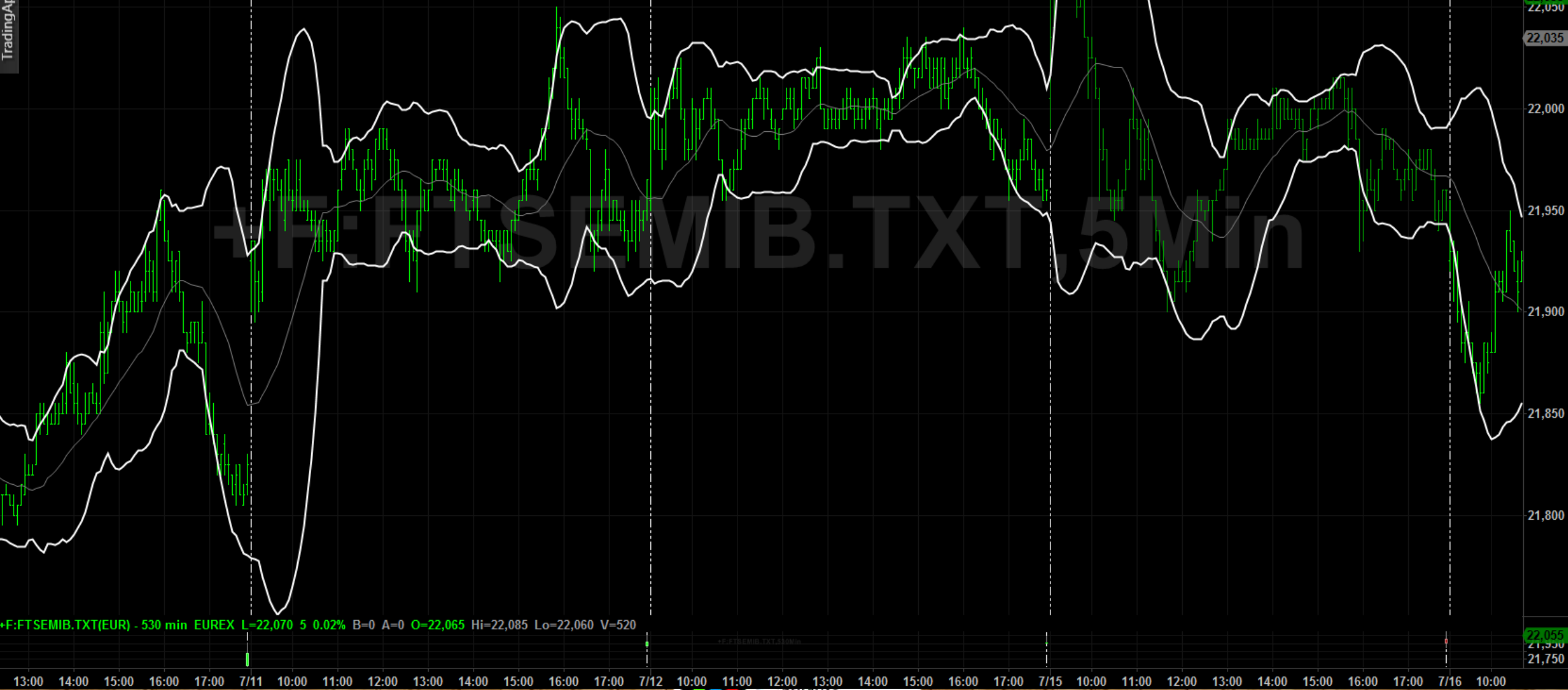
#	Name	Start Day	Start Time	End Day	End Time	SEOC
1		Mon	9:00 AM	Mon	5:50 PM	✓
2		Tue	9:00 AM	Tue	5:50 PM	✓
3		Wed	9:00 AM	Wed	5:50 PM	✓
4		Thu	9:00 AM	Thu	5:50 PM	✓

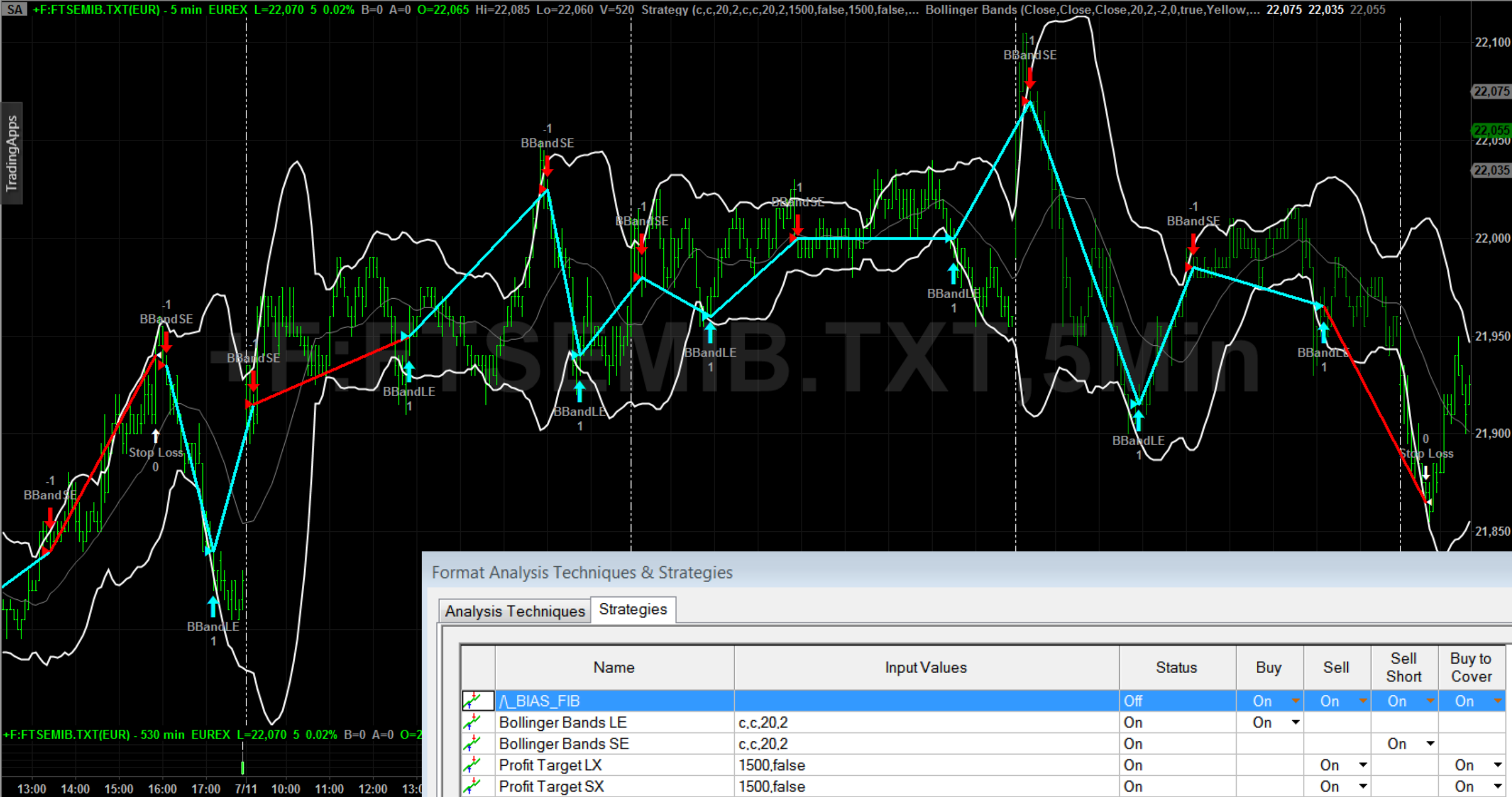
CUSTOM SESSION SUL FIB

SA +F:FTSEMIB.TXT(EUR) - 5 min EUREX L=22,070 5 0.02% B=0 A=0 O=22,065 Hi=22,085 Lo=22,060 V=520 Strategy (1500,false,1500,false,500,false,500,false) Bollinger Bands (Close,Close,Close,20,2,-2,0,true,Yellow,... 22,075 22,035 22,055

TradingApps

ci serve un'idea da cui partire...





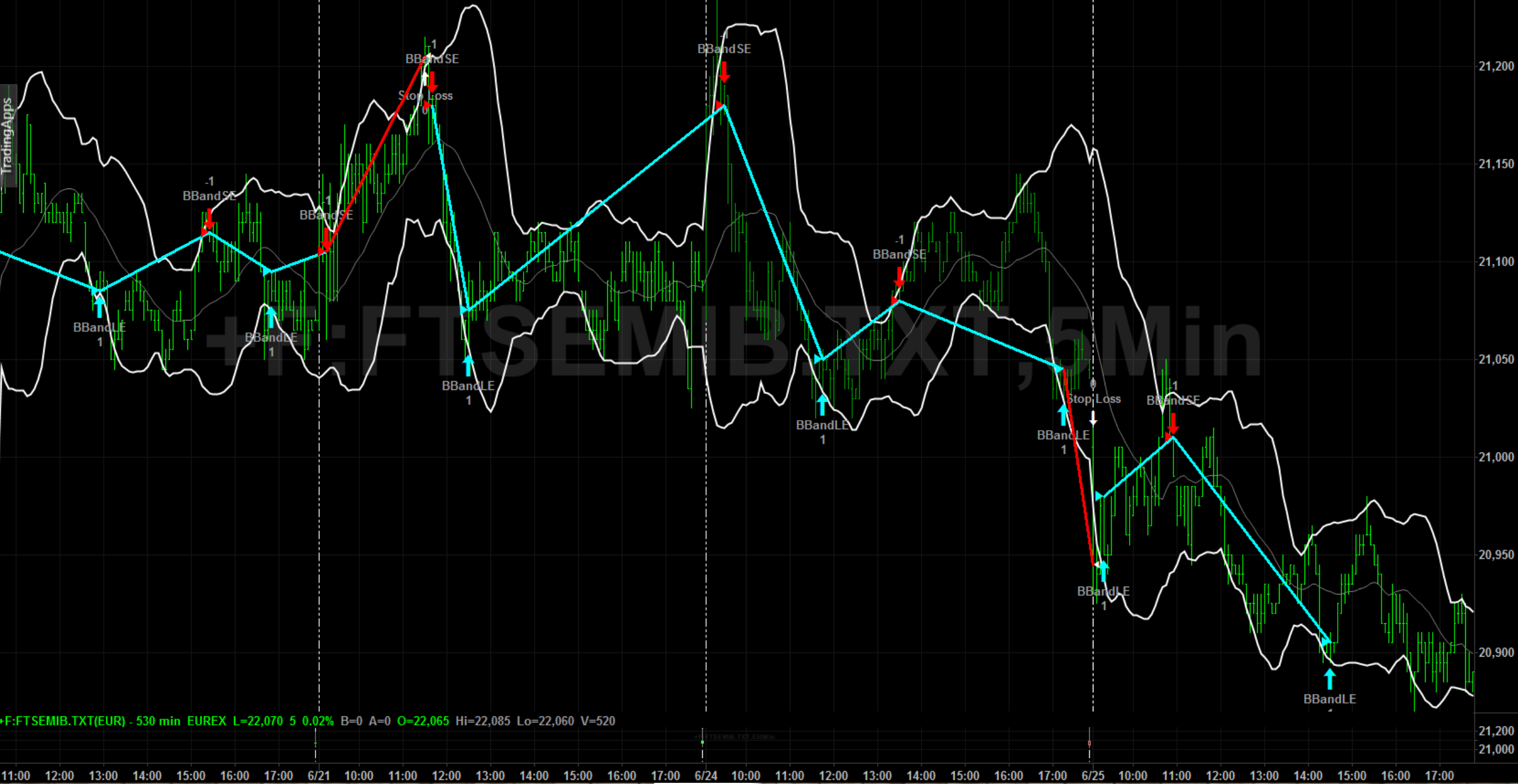
Format Analysis Techniques & Strategies

Analysis Techniques Strategies

	Name	Input Values	Status	Buy	Sell	Sell Short	Buy to Cover
	_BIAS_FIB		Off	On	On	On	On
	Bollinger Bands LE	c,c,20,2	On	On			
	Bollinger Bands SE	c,c,20,2	On			On	
	Profit Target LX	1500,false	On		On		On
	Profit Target SX	1500,false	On		On		On
	Stop Loss LX	500,false	On		On		On
	Stop Loss SX	500,false	On		On		On

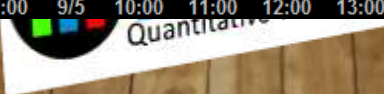
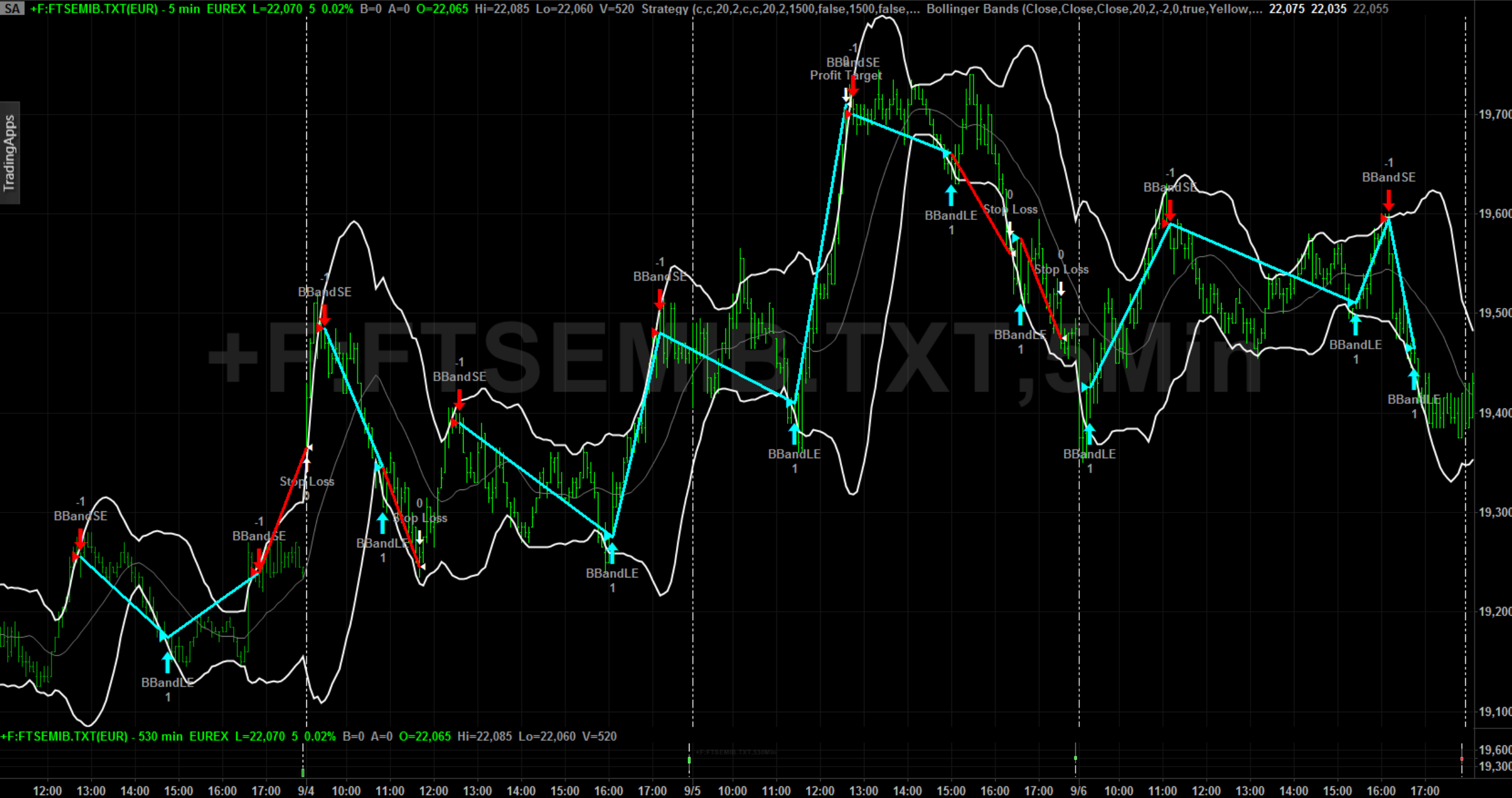
SA +F:FTSEMIB.TXT(EUR) - 5 min EUREX L=22,070 5 0.02% B=0 A=0 O=22,065 Hi=22,085 Lo=22,060 V=520 Strategy (c,c,20,2,c,c,20,2,1500,false,1500,false,... Bollinger Bands (Close,Close,Close,20,2,-2,0,true,Yellow,... 22,075 22,035 22,055

TradingApps

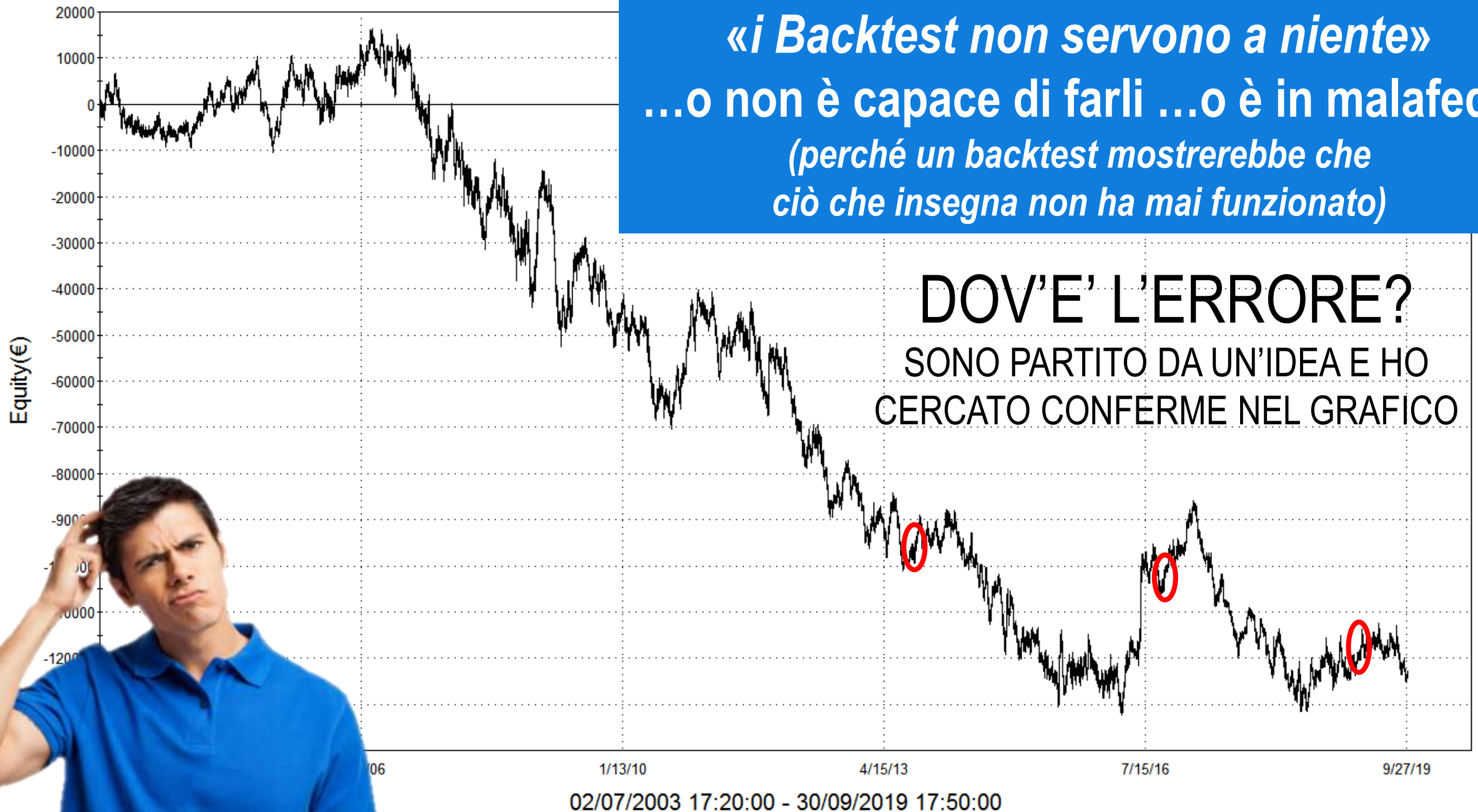


+F:FTSEMIB.TXT(EUR) - 530 min EUREX L=22,070 5 0.02% B=0 A=0 O=22,065 Hi=22,085 Lo=22,060 V=520

11:00 12:00 13:00 14:00 15:00 16:00 17:00 6/21 10:00 11:00 12:00 13:00 14:00 15:00 16:00 17:00 6/24 10:00 11:00 12:00 13:00 14:00 15:00 16:00 17:00 6/25 10:00 11:00 12:00 13:00 14:00 15:00 16:00 17:00



Quando sentite dire a qualcuno che
«*i Backtest non servono a niente*»
...o non è capace di farli ...o è in malafede
(perché un backtest mostrerebbe che
ciò che insegna non ha mai funzionato)



PERCHÉ UN APPROCCIO MECCANICO AL TRADING

Se qualcosa **ha funzionato** nel passato, **non è detto** che continuerà a funzionare **anche in futuro...** ma è un buono inizio!

Se qualcosa NON ha mai funzionato nel passato, è improbabile che inizierà a funzionare **proprio adesso** che inizi a farci trading sopra...



...LA SFIDA DI OGGI : LA **SEMPLICITÀ**!

```
Inputs:      LowVol(True), ClimaxUp(True), ClimaxDown(True), Churn(True), Clima
            LowVolColor(Yellow), ClimaxUpColor(Red), ClimaxDownColor(White), C
            UseUpTicks(True), Use2Bars(True), ShowAvg(False), AvgColor(Red);
Variables:   BarColor(Cyan), Lookback(20);
```

```
BarColor = Color;
```

```
If BarType > 1 then begin
```

```
  If C > 0 and Range <> 0 then Value1 = (Range/(2*Range+O-C))*V;
```

```
  If C < 0 and Range <> 0 then Value1 = ((Range+C-O)/(2*Range+C-O))*V;
```

```
  If C = 0 then Value1 = 0.5*V;
```

```
  Value2 = V-Value1;
```

```
End;
```

```
If BarType <= 1 and UseUpTicks = False then begin
```

```
  If C > 0 and Range <> 0 then Value1 = (Range/(2*Range+O-C))*Ticks;
```

```
  If C < 0 and Range <> 0 then Value1 = ((Range+C-O)/(2*Range+C-O))*Ticks;
```

```
  If C = 0 then Value1 = 0.5*Ticks;
```

```
  Value2 = Ticks-Value1;
```

```
End;
```

```
If BarType <= 1 and UseUpTicks then begin
```

```
  Value1 = UpTicks;
```

```
  Value2 = DownTicks;
```

```
End;
```

```
Value3 = AbsValue(Value1+Value2);
```

```
Value4 = Value1*Range;
```

```
Value5 = (Value1-Value2)*Range;
```

```
Value6 = Value2*Range;
```

```
Value7 = (Value2-Value1)*Range;
```

```
If Range <> 0 then begin
```

SE VOGLIAMO TESTARE UN'IDEA
DOBBIAMO IMPARARE A **CODIFICARLA**

QTLab
Quantitative Trading Lab



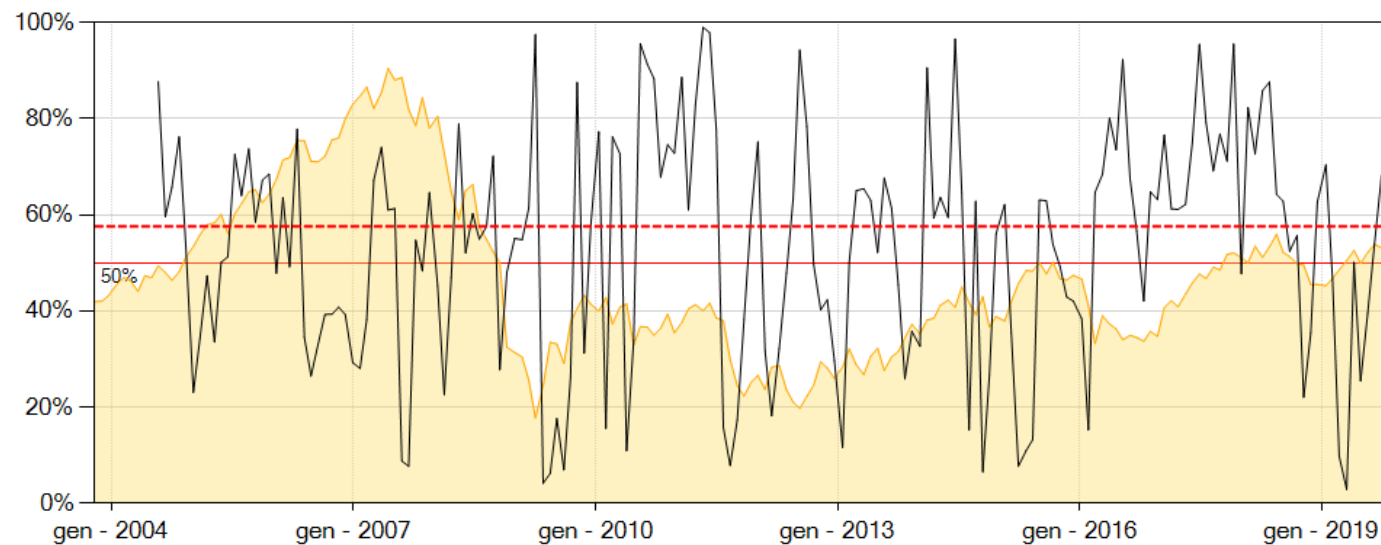
Horizon:

Months: ☐ 66 (3m) ☐ 132 (6m) ☒ 264 (1y) ☐ 792 (3y) ☐ 1320 (5y)

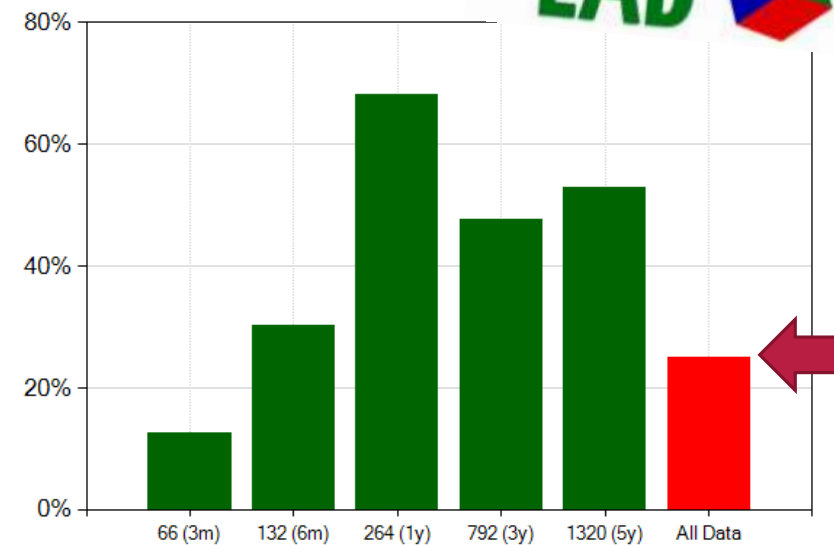
Augmented Dickey-Fuller:

☐ T Statistic ☒ P-Value ☒ Show Price

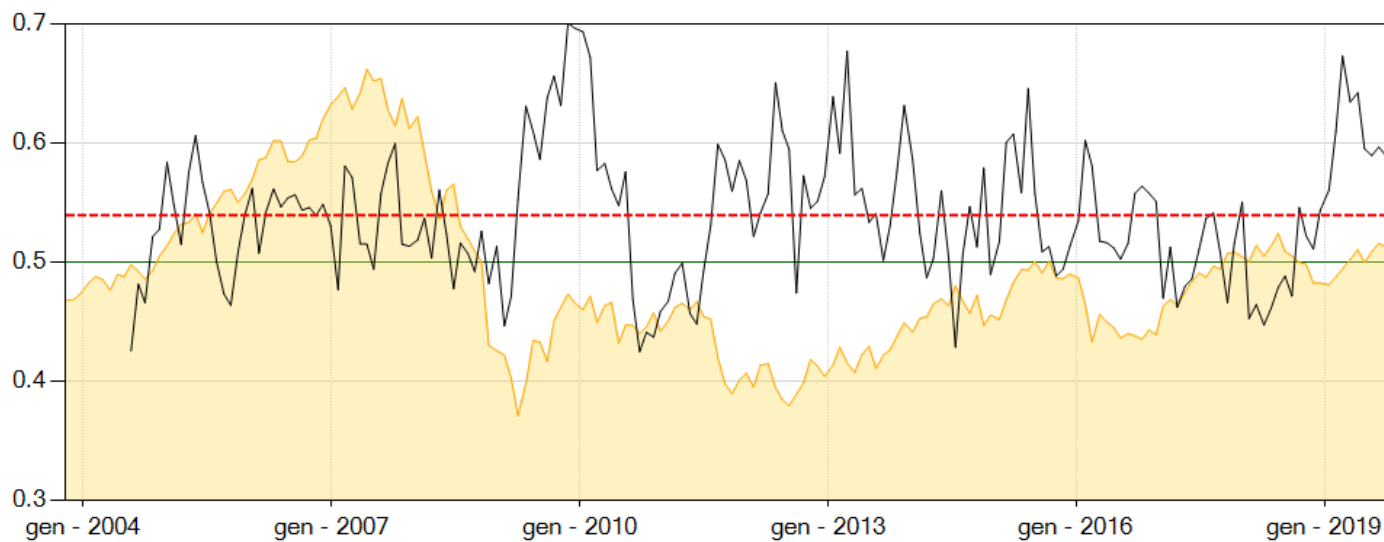
Rolling Augmented Dickey-Fuller Test (1 - P-Value)



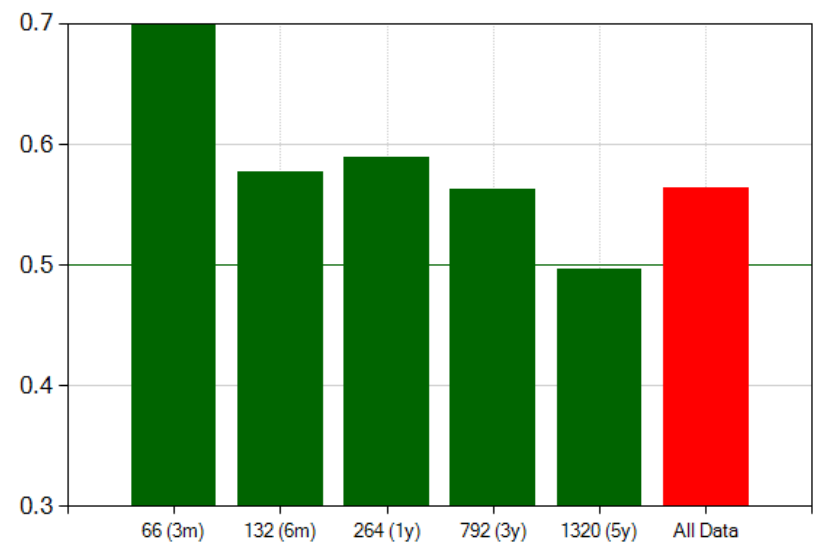
Augmented Dickey-Fuller Test



Rolling Hurst Exponent



Hurst Exponent



Seasonal: ☒ Year ☐ Week ☐ Show All Data ☒ Show N Years ☒ Show Last Year ☐ Show Single Year ☐ Show Components ☒ Show Y Labels ☐ Plot Week Lines

Significance: 70 % Trend: 2.000 % Window Size: 25 ☐ Significance on Components

Highlight 5 / 17 (2015)
Years Back: 17 / 17 (2003)

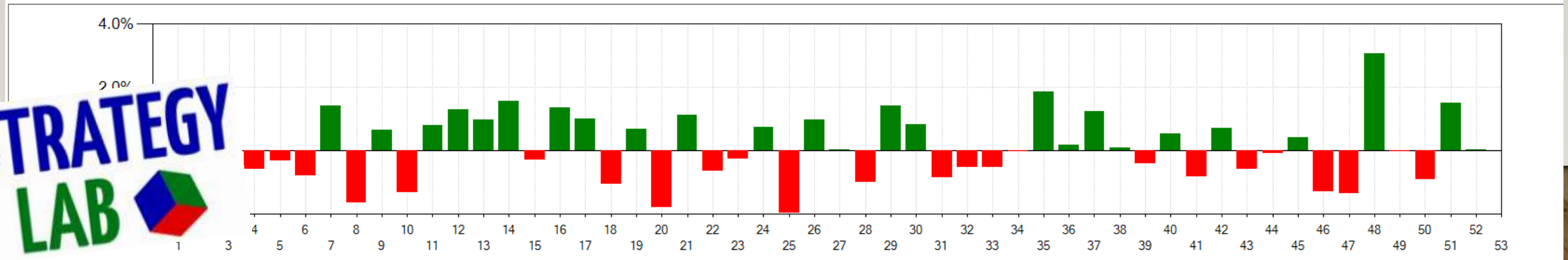
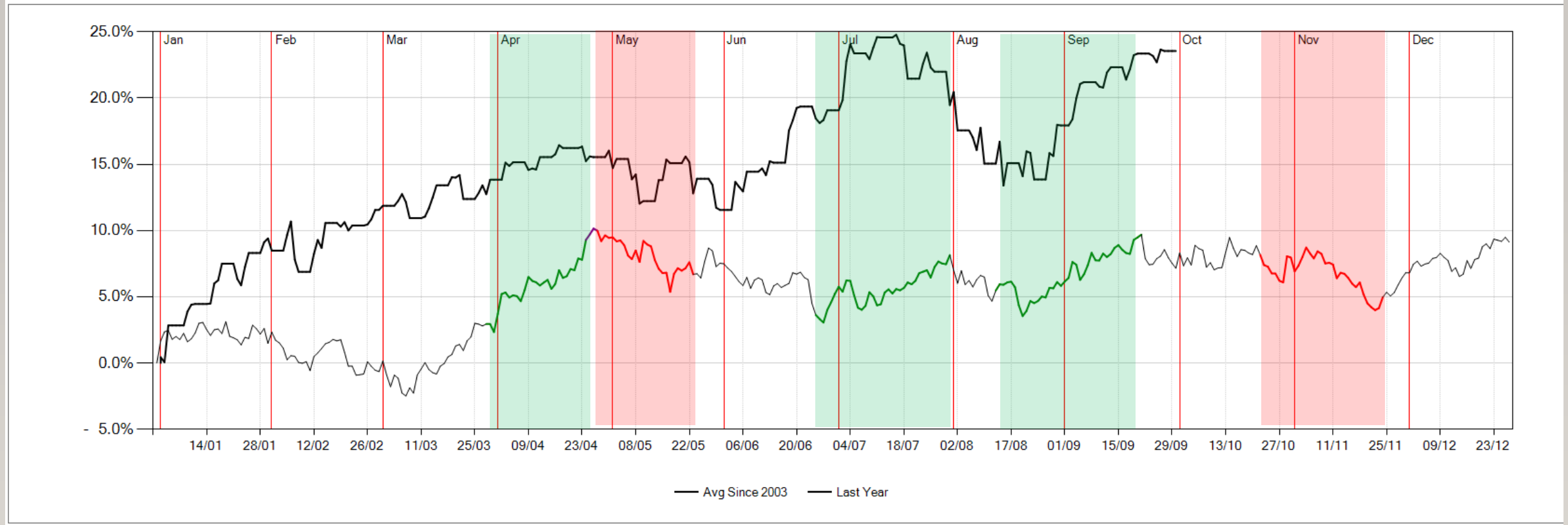


Chart Bias Analysis Seasonal Analysis **Statistic Analysis**Seasonal: ☒ Year ☐ Week☐ Show All Data☒ Show N Years☒ Show Last Year☐ Show Single Year☐ Show Components☒ Show Y Labels☐ Plot Week Lines

Hilght 5 / 17 (2015)

Years Back 17 / 17 (2003)

Significance: 70 % Trend: 2.000 % Window Size: 25 ☐ Significance on Components**Test**

SeasonalTest

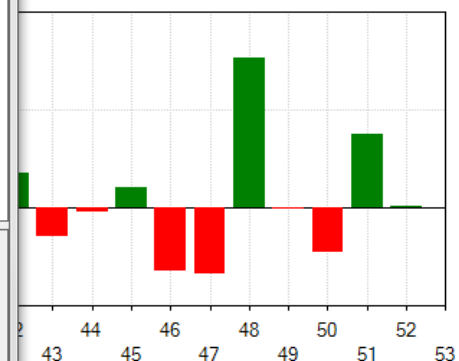
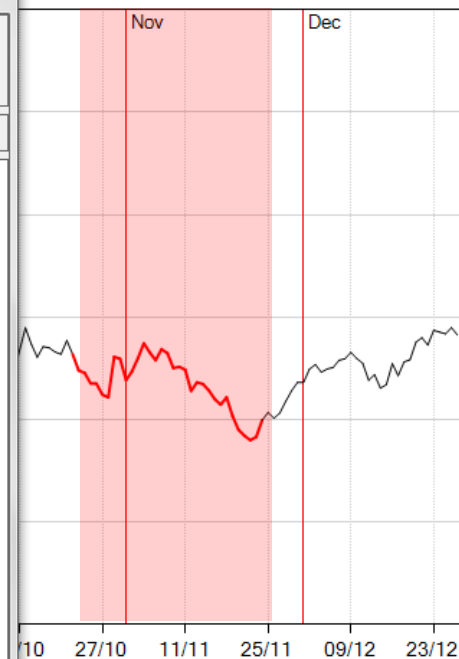
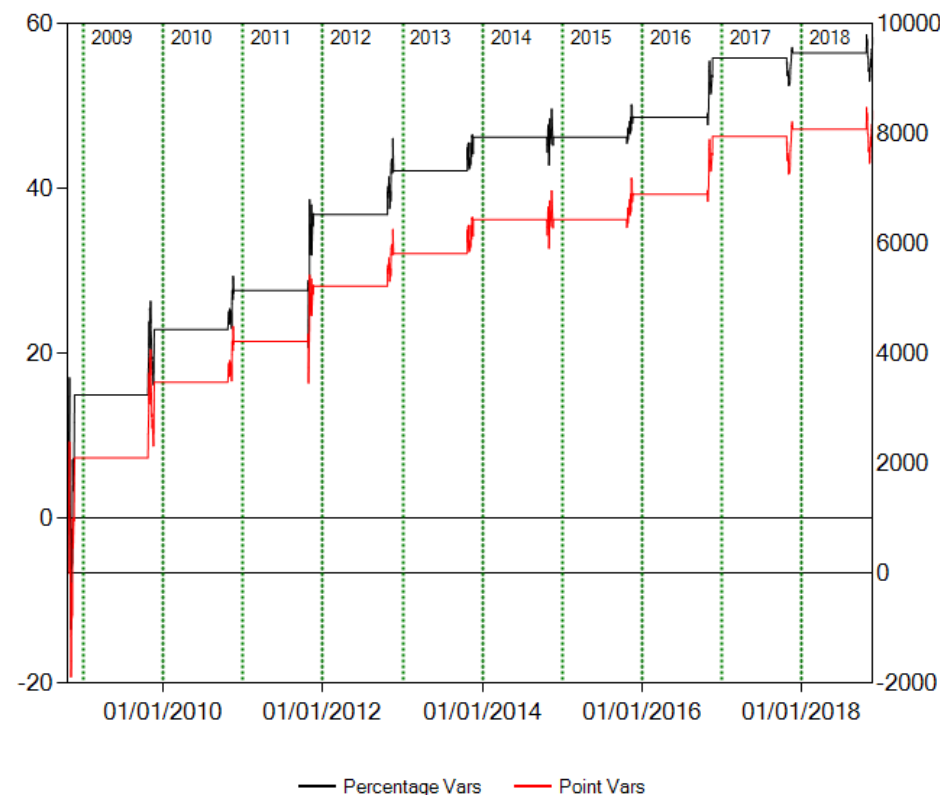
Select Window

From 22 / 10

To 21 / 11

Execute

Year	Entry Date	Exit Date	E Price	X Price	Pnt	% Var
2018	22/10/2018	20/11/2018	17920	17580	-340	-1.90%
2017	23/10/2017	20/11/2017	20470	20340	-130	-0.64%
2016	24/10/2016	18/11/2016	14610	13560	-1050	-7.19%
2015	22/10/2015	20/11/2015	19240	18780	-460	-2.39%
2014	22/10/2014	20/11/2014	15395	15390	-5	-0.03%
2013	22/10/2013	20/11/2013	15085	14470	-615	-4.08%
2012	22/10/2012	20/11/2012	11135	10545	-590	-5.30%
2011	24/10/2011	18/11/2011	10945	9940	-1005	-9.18%
2010	22/10/2010	19/11/2010	15730	14985	-745	-4.74%
2009	22/10/2009	20/11/2009	17360	15985	-1375	-7.92%
2008	22/10/2008	20/11/2008	14025	11920	-2105	-15.01%
2007	22/10/2007	20/11/2007	31950	30625	-1325	-4.15%
2006	23/10/2006	20/11/2006	32005	33320	1315	4.11%
2005	24/10/2005	18/11/2005	24650	26010	1360	5.52%
2004	22/10/2004	19/11/2004	19965	21130	1165	5.84%
2003	22/10/2003	20/11/2003	16475	17145	670	4.07%

☒ Percentage Vars ☒ Point Vars☒ Trade Last 17 Years (2003)☐ Long
☒ Short☒ Trade only years after:

Negative Year

Performance

Avg Var: 5.31%

Trades: 11

Percent Profitable: 100.0%

Win Loss Ratio: 0.00

Winners: 11

Losers: 0

Avg Winner: 5.31%

Avg Loser: 0%

SHORT STRANGLE CON DIFESA MECCANICA

OPZIONI + FUTURES

4 PROTOCOLLI
PER LA VENDITA SISTEMATICA
DI OPZIONI WEEKLY, CONTROLLANDO
IL RISCHIO CON IL FUTURE SOTTOSTANTE

SHORT STRANGLE ADVANCED

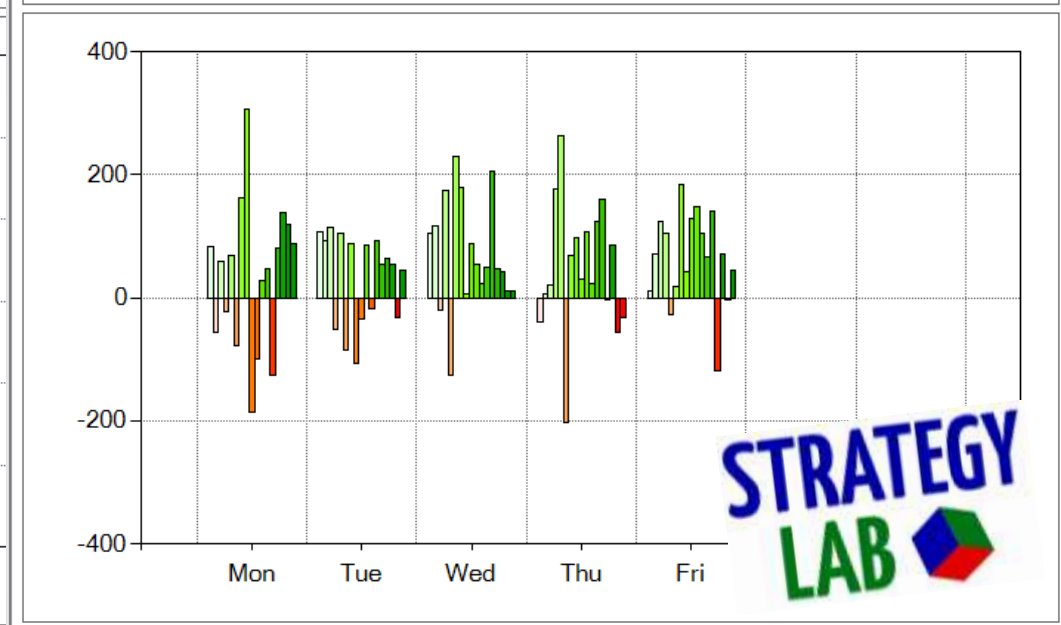
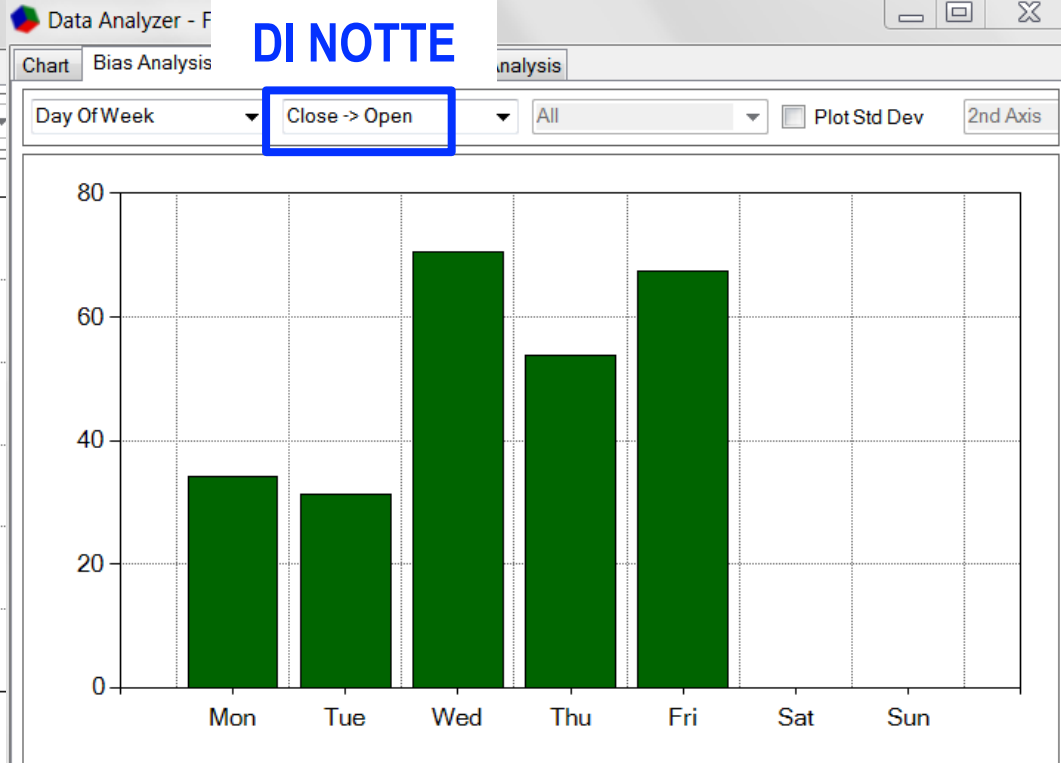
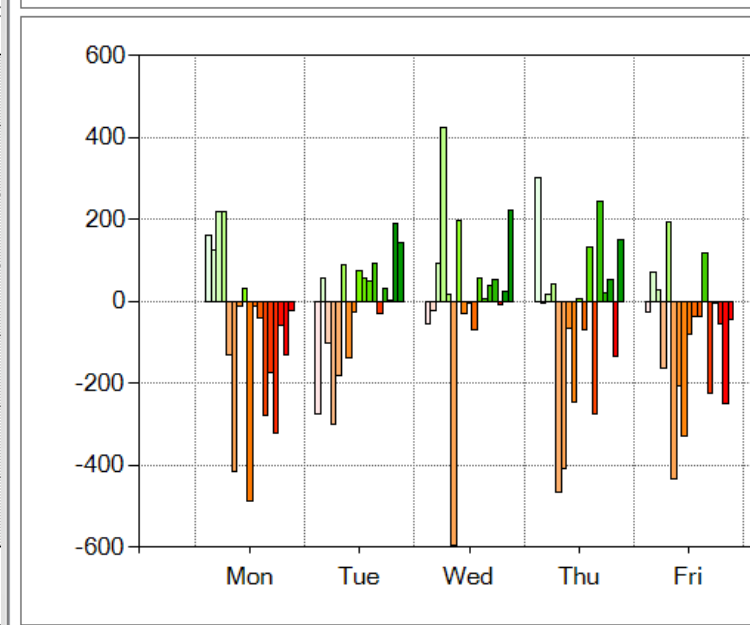
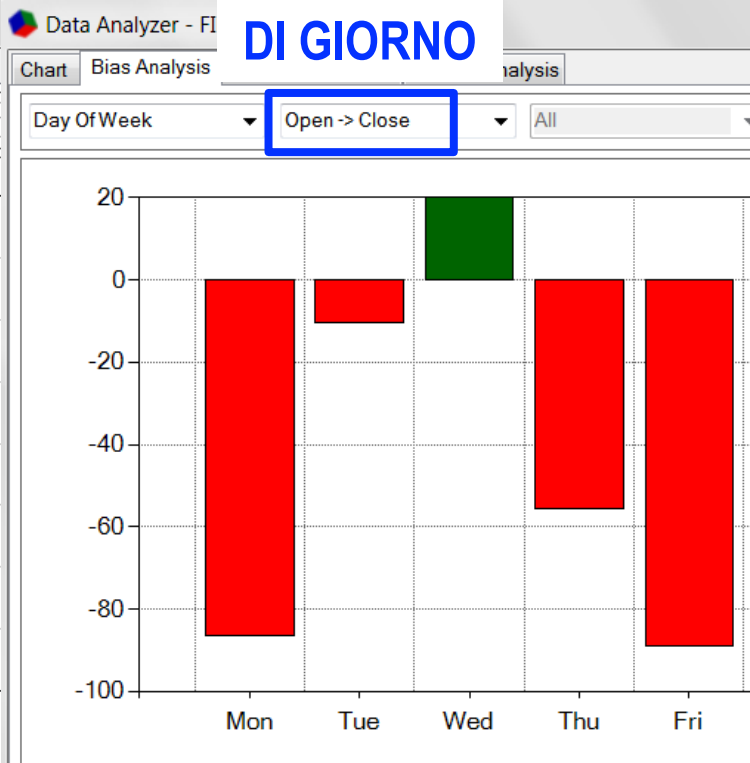
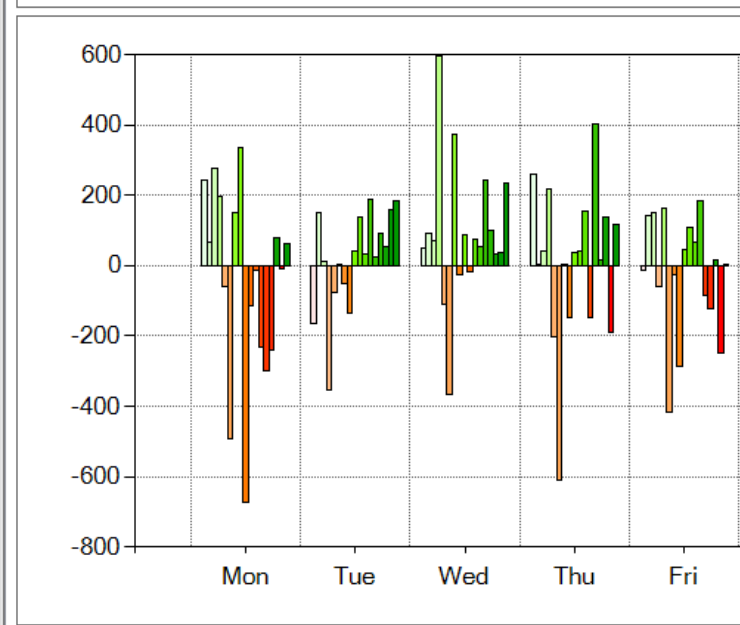
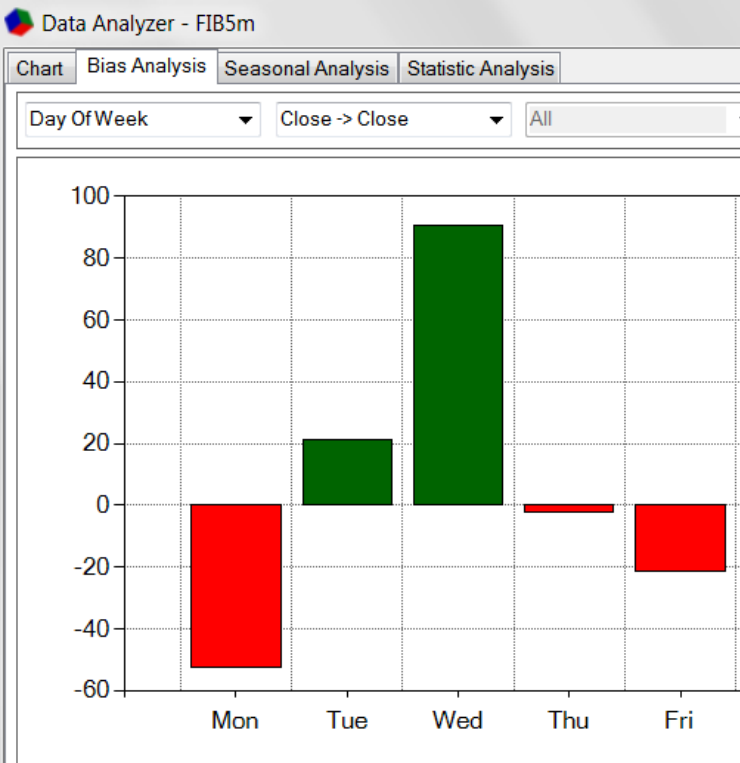
5 PROTOCOLLI PER COMBINARE
OPZIONI E TRADING SYSTEMS



Data Analyzer - FIB5m

30 Novembre + 1 Dicembre





Data Analyzer - FIB5m

Chart

Bias Analysis

Seasonal Analysis

Statistic Analysis

Seasonal: ☐ Year ☒ Week

☐ Show All Data ☒ Show N Years ☐ Show Last Year ☐ Show Single Year ☐ Show Components

☒ Show Y Labels ☒ Plot Session End

Highlight

5 / 11 (2015)

Years Back:

11 / 17 (2009)

Significance:

52

 % Trend:

0.030

 % Window Size:

7

☐ Significance on Components

Test

This line chart displays the average bias since 2009 for FIB5m data. The y-axis represents the bias percentage, ranging from -0.200% to 0.400%. The x-axis shows time segments for Monday, Tuesday, Wednesday, Thursday, and Friday, each divided into 18 sub-segments. The chart is segmented by day of the week, with Monday, Wednesday, Thursday, and Friday highlighted in red, and Tuesday highlighted in green. The data series is labeled 'Avg Since 2009'.

Day	Segment	Bias (%)	
Monday	09	0.000%	
	10	0.060%	
	11	0.000%	
	12	-0.010%	
	13	-0.020%	
	14	-0.030%	
	15	-0.040%	
	16	-0.050%	
	17	-0.060%	
	18	-0.070%	
	Tuesday	09	-0.070%
		10	-0.080%
		11	-0.090%
		12	-0.080%
		13	-0.070%
		14	-0.060%
		15	-0.050%
		16	-0.040%
17		-0.030%	
18		-0.020%	
Wednesday		09	-0.020%
		10	-0.010%
		11	0.000%
		12	0.010%
		13	0.020%
		14	0.030%
		15	0.040%
		16	0.050%
	17	0.060%	
	18	0.070%	
	Thursday	09	0.070%
		10	0.080%
		11	0.090%
		12	0.100%
		13	0.110%
		14	0.120%
		15	0.130%
		16	0.140%
17		0.150%	
18		0.160%	
Friday		09	0.160%
		10	0.170%
		11	0.180%
		12	0.190%
		13	0.200%
		14	0.210%
		15	0.220%
		16	0.230%
	17	0.240%	
	18	0.250%	

This bar chart displays the daily bias for FIB5m data. The y-axis represents the bias percentage, ranging from -0.040% to 0.100%. The x-axis shows time segments for Monday, Tuesday, Wednesday, Thursday, and Friday, each divided into 18 sub-segments. The chart is segmented by day of the week, with Monday, Wednesday, Thursday, and Friday highlighted in red, and Tuesday highlighted in green. The bars are colored green for positive bias and red for negative bias.

Day	Segment	Bias (%)	
Monday	09	0.060%	
	10	-0.010%	
	11	-0.010%	
	12	-0.020%	
	13	-0.010%	
	14	-0.010%	
	15	0.000%	
	16	-0.030%	
	17	-0.020%	
	18	0.000%	
	Tuesday	09	0.060%
		10	-0.020%
		11	-0.010%
		12	0.020%
		13	0.020%
		14	-0.010%
		15	0.000%
		16	0.005%
17		0.000%	
18		0.015%	
Wednesday		09	0.095%
		10	-0.010%
		11	0.025%
		12	0.005%
		13	0.010%
		14	0.010%
		15	-0.010%
		16	-0.010%
	17	-0.015%	
	18	0.030%	
	Thursday	09	0.065%
		10	0.005%
		11	0.010%
		12	-0.030%
		13	0.010%
		14	0.010%
		15	-0.030%
		16	-0.010%
17		-0.040%	
18		0.020%	
Friday		09	0.055%
		10	-0.010%
		11	-0.015%
		12	-0.030%
		13	-0.010%
		14	0.005%
		15	0.005%
		16	-0.015%
	17	-0.015%	
	18	0.035%	

Select Window

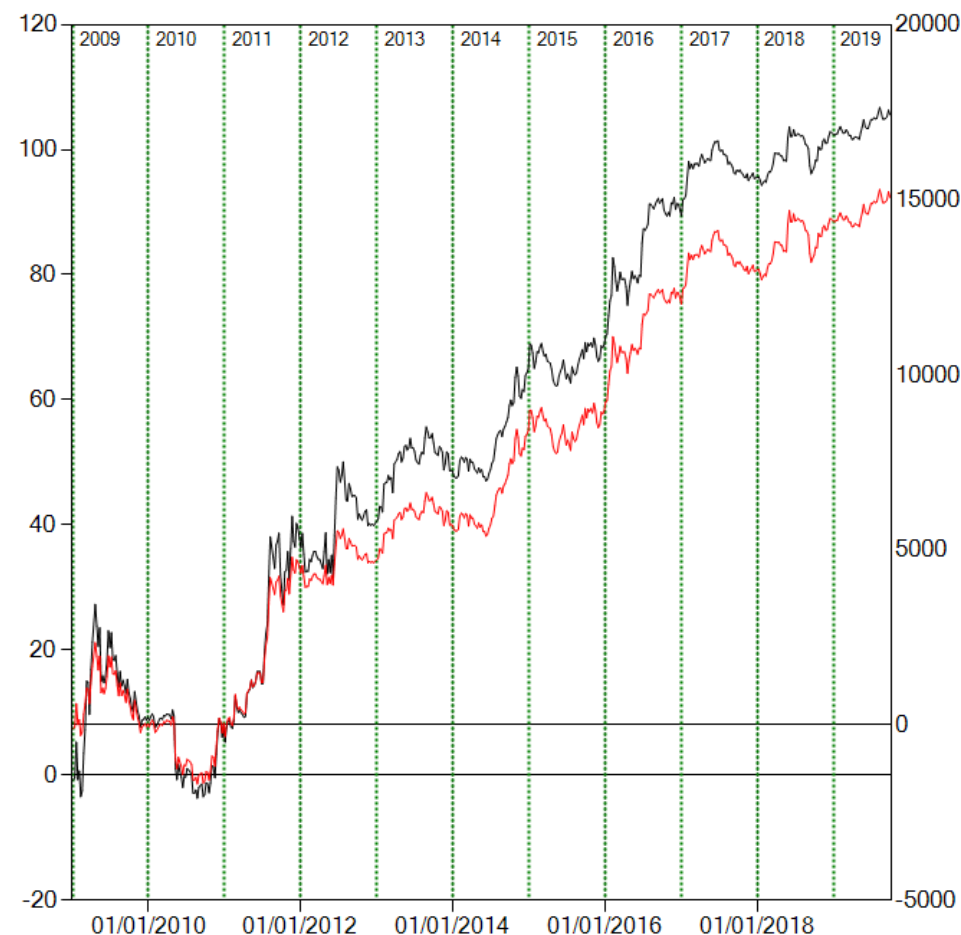
From Mon 9 To Mon 17

First Day Of Week: Mon

Execute

Year	Entry Date	Entry	Exit Date	Exit	E Price	X Price
2019	30/09/2019 - Mon	09:05	30/09/2019 - Mon	17:00	21910	22070
2019	23/09/2019 - Mon	09:05	23/09/2019 - Mon	17:00	22015	21790
2019	16/09/2019 - Mon	09:05	16/09/2019 - Mon	17:00	21965	21900
2019	09/09/2019 - Mon	09:05	09/09/2019 - Mon	17:00	21835	21815
2019	02/09/2019 - Mon	09:05	02/09/2019 - Mon	17:00	21280	21285
2019	26/08/2019 - Mon	09:05	26/08/2019 - Mon	17:00	20260	20460
2019	19/08/2019 - Mon	09:05	19/08/2019 - Mon	17:00	20380	20550
2019	12/08/2019 - Mon	09:05	12/08/2019 - Mon	17:00	20335	20155
2019	05/08/2019 - Mon	09:05	05/08/2019 - Mon	17:00	20750	20575
2019	29/07/2019 - Mon	09:05	29/07/2019 - Mon	17:00	21620	21600
2019	22/07/2019 - Mon	09:05	22/07/2019 - Mon	17:00	21480	21520
2019	15/07/2019 - Mon	09:05	15/07/2019 - Mon	17:00	22035	21965
2019	08/07/2019 - Mon	09:05	08/07/2019 - Mon	17:00	21725	21730
2019	01/07/2019 - Mon	09:05	01/07/2019 - Mon	17:00	21225	21070
2019	24/06/2019 - Mon	09:05	24/06/2019 - Mon	17:00	21180	21035
2019	17/06/2019 - Mon	09:05	17/06/2019 - Mon	17:00	20345	20350
2019	10/06/2019 - Mon	09:05	10/06/2019 - Mon	17:00	20100	20150
2019	03/06/2019 - Mon	09:05	03/06/2019 - Mon	17:00	19300	19520
2019	27/05/2019 - Mon	09:05	27/05/2019 - Mon	17:00	20225	19990
2019	20/05/2019 - Mon	09:05	20/05/2019 - Mon	17:00	20415	20245
2019	13/05/2019 - Mon	09:05	13/05/2019 - Mon	17:00	20145	19910
2019	06/05/2019 - Mon	09:05	06/05/2019 - Mon	17:00	20630	20680
2019	29/04/2019 - Mon	09:05	29/04/2019 - Mon	17:00	21025	21060
2019	15/04/2019 - Mon	09:05	15/04/2019 - Mon	17:00	21100	21025
2019	08/04/2019 - Mon	09:05	08/04/2019 - Mon	17:00	20925	20915
2019	01/04/2019 - Mon	09:05	01/04/2019 - Mon	17:00	20555	20680
2019	25/03/2019 - Mon	09:05	25/03/2019 - Mon	17:00	20190	20190
2019	18/03/2019 - Mon	09:05	18/03/2019 - Mon	17:00	20230	20340
2019	11/03/2019 - Mon	09:05	11/03/2019 - Mon	17:00	19680	19755
2019	04/03/2019 - Mon	09:05	04/03/2019 - Mon	17:00	19940	19840
2019	25/02/2019 - Mon	09:05	25/02/2019 - Mon	17:00	19580	19570

Year	Trd	% Prof	W/L	Avg %
2019	38	52.6%	1.15	0.071%
2018	49	55.1%	1.27	0.153%
2017	49	49.0%	1.32	0.084%
2016	49	57.1%	1.58	0.460%
2015	51	49.0%	1.20	0.074%
2014	51	58.8%	1.36	0.322%
2013	51	51.0%	1.32	0.170%
2012	50	46.0%	1.14	0.010%
2011	49	55.1%	1.29	0.643%
2010	51	47.1%	1.08	-0.026%
2009	51	49.0%	1.20	0.181%
11	49.0	51.8%	1.26	0.195%

☒ Percentage Vars
 ☒ Point Vars


— Percentage Vars — Point Vars

Performance

 Avg Var: 0.196%
 Trades: 539
 Percent Profitable: 51.8%
 Win Loss Ratio: 1.24

 Winners: 279
 Losers: 254
 Avg Winner: 1.435%
 Avg Loser: -1.161%

 Positive Week
 Negative Week
 Compression Week
 Expansion Week
 High 3rd Week
 Low 3rd Week
 Positive Week

☒ Trade Last 11 Year

Filter

☐ Trade only weeks after:

SA +F:FTSEMIB.TXT(EUR) - 5 min EUREX L=22,070 5 0.02% B=0 A=0 O=22,065 Hi=22,085 Lo=22,060 V=520 Strategy ()

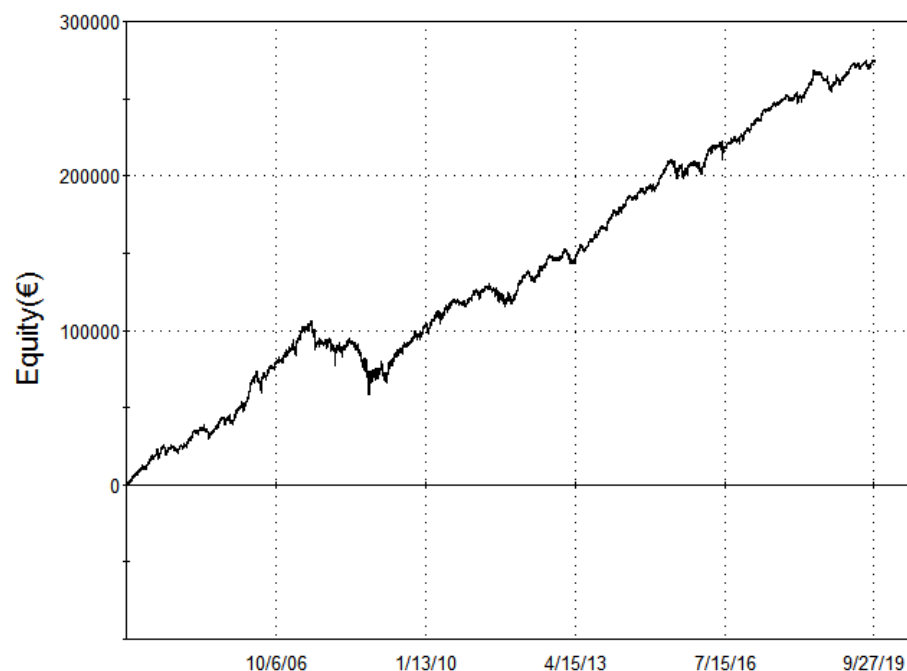
da Data Analyzer a TradeStation...

TradeStation Strategy Performance Report - +F:FTSEMIB.TXT 5 min (01/07/2003-30/09/...

Symbol(EUR) ALL Data

Equity Curve Detailed

Equity Curve Detailed - +F:FTSEMIB.TXT 5 min.(01/07/2003 09:20 - 30/09/2019 17:50)



02/07/2003 17:20:00 - 30/09/2019 17:50:00

Performance Summary Trade Analysis Trades List Periodical Returns Performance Graphs Trade Graphs Settings



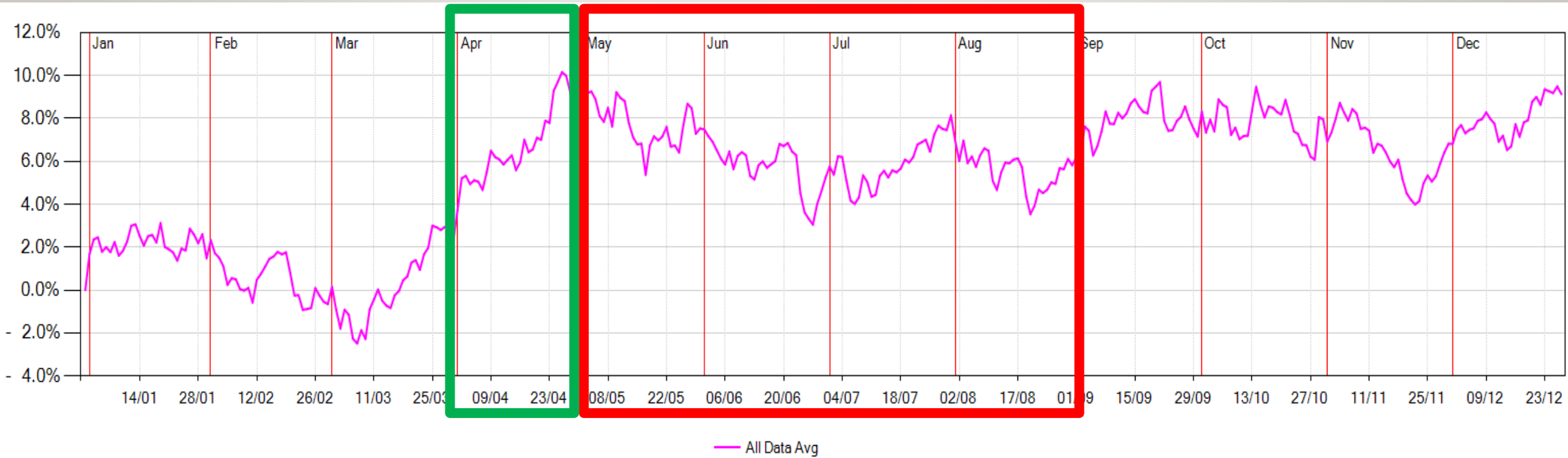
TradeStation Development Environment - _BIAS_FIB : Strategy*

File Edit View Build Debug Tools Window Help

_BIAS_FIB : Strategy*

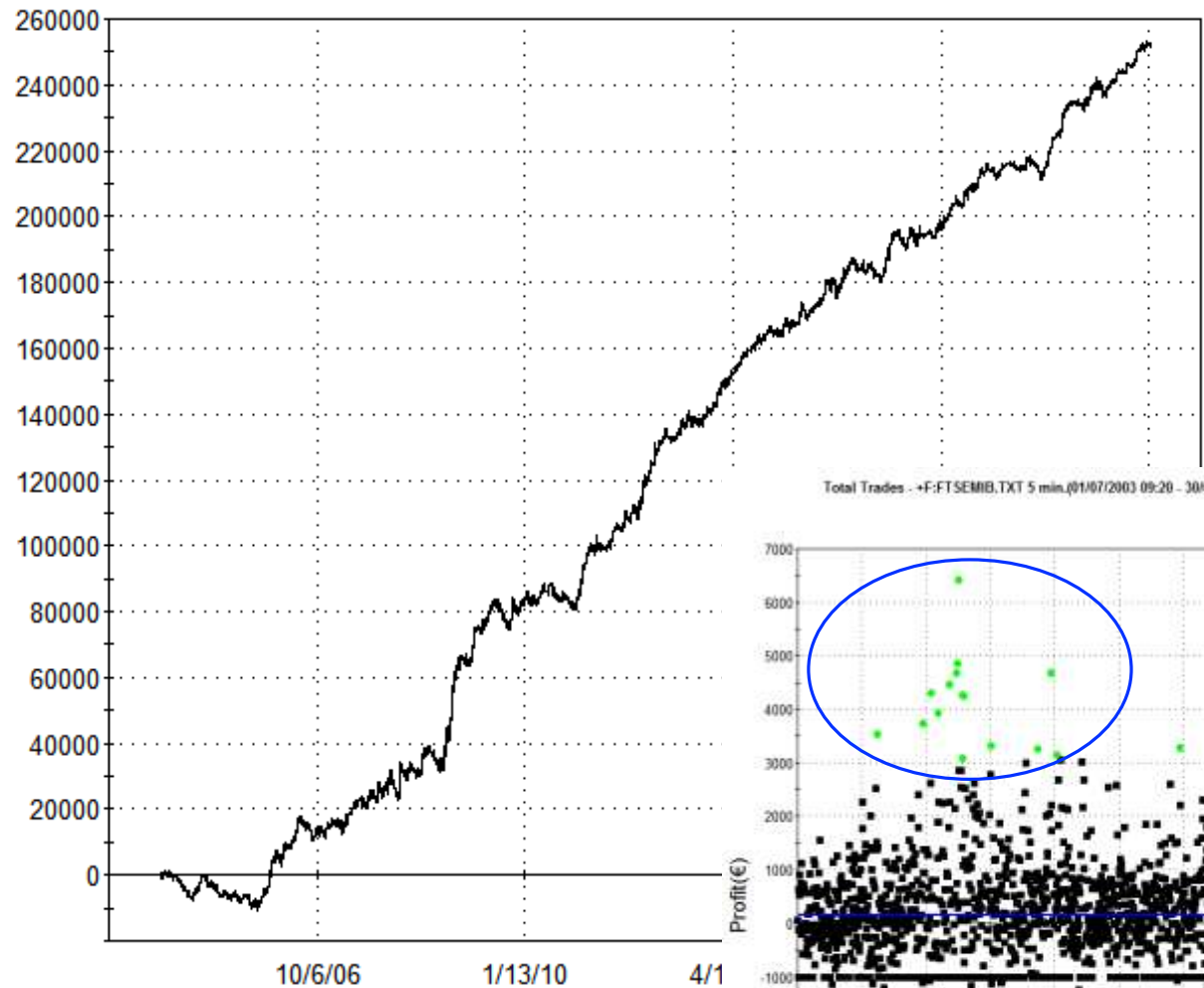
```
1
2 If t=1700 then buy next bar at market;
3 If t=905 then sell next bar at market;
4
5
6
```

FILTRO STAGIONALITA'



Equity Curve Detailed - +F:FTSEMIB.TXT 5 min.(01/07/2003 09:20 - 30/09/2019 17:50)

Equity(€)

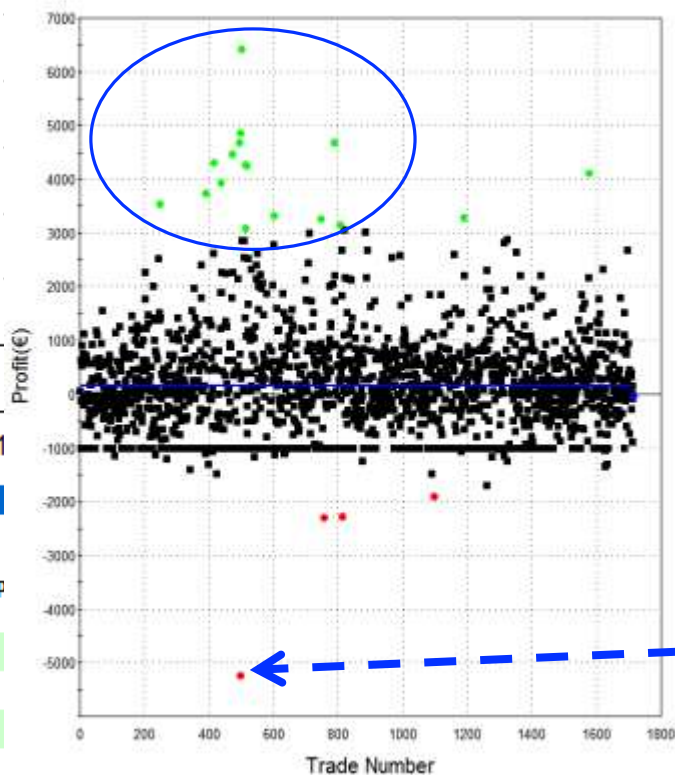


TradeStation Periodical Returns: Annual

Mark-To-Market Period Analysis:

Period	Net Profit	% Gain	Profit Factor	# Trades	% F
Last 12 month	€ 16.675,00	4.98%	1.80	113	
01/01/2019	€ 11.850,00	3.49%	2.01	81	
01/01/2018	€ 24.500,00	7.77%	2.15	103	
01/01/2017	€ 6.050,00	1.96%	1.27	116	
01/01/2016	€ 18.025,00	6.19%	1.62	108	

Total Trades - +F:FTSEMIB.TXT 5 min.(01/07/2003 09:20 - 30/09/2019 17:50)



TradeStation Performance Summary

Expand

	All Trades	Long Trades	Short Trades
Total Net Profit	€ 251.575,00	€ 108.475,00	€ 143.100,00
Gross Profit	€ 706.625,00	€ 264.850,00	€ 441.775,00
Gross Loss	-€ 455.050,00	-€ 156.375,00	-€ 298.675,00
Profit Factor	1.55	1.69	1.48
Total Number of Trades	1,713	760	953
Percent Profitable	53.77%	56.71%	51.42%
Winning Trades	921	431	490
Losing Trades	757	306	451
Even Trades	35	23	12
Avg. Trade Net Profit	€ 146,86	€ 142,73	€ 150,16
Avg. Winning Trade	€ 767,24	€ 614,50	€ 901,58
Avg. Losing Trade	-€ 601,12	-€ 511,03	-€ 662,25
Ratio Avg. Win:Avg. Loss	1.28	1.20	1.36
Largest Winning Trade	€ 6.425,00	€ 6.425,00	€ 4.875,00
Largest Losing Trade	-€ 5.225,00	-€ 5.225,00	-€ 1.000,00
Max. Consecutive Winning Trades	10	10	10
Max. Consecutive Losing Trades	7	5	11
Avg. Bars in Winning Trades	55.23	10.57	94.51
Avg. Bars in Losing Trades	46.23	10.24	70.65
Avg. Bars in Even Trades	39.40	10.78	94.25
Max. Shares/Contracts Held	1	1	1
Total Shares/Contracts Held	1,714	761	953
Account Size Required	€ 11.575,00	€ 5.475,00	€ 14.925,00
Return on Initial Capital	251.58%		
Annual Rate of Return	7.74%		
Return Retracement Ratio	4.82		
RINA Index	2,172.11		
Trading Period	16 Years, 2 Months, 29 days, 30 Minutes		
Percent of Time in the Market	18.30%		
Max. Equity Run-up	€ 263.850,00		
Max. Drawdown (Intra-day Peak to Valley)			
Value	-€ 12.275,00	-€ 7.050,00	-€ 16.125,00
Net Profit as % of Drawdown	2,049.49%	1,538.65%	887.44%
Max. Drawdown (Trade Close to Trade Close)			
Value	-€ 11.575,00	-€ 5.475,00	-€ 14.925,00
Net Profit as % of Drawdown	2,173.43%	1,981.28%	958.79%
Max. Trade Drawdown	-€ 5.225,00	-€ 5.225,00	-€ 1.000,00

INTRADAY TRADING SYSTEM

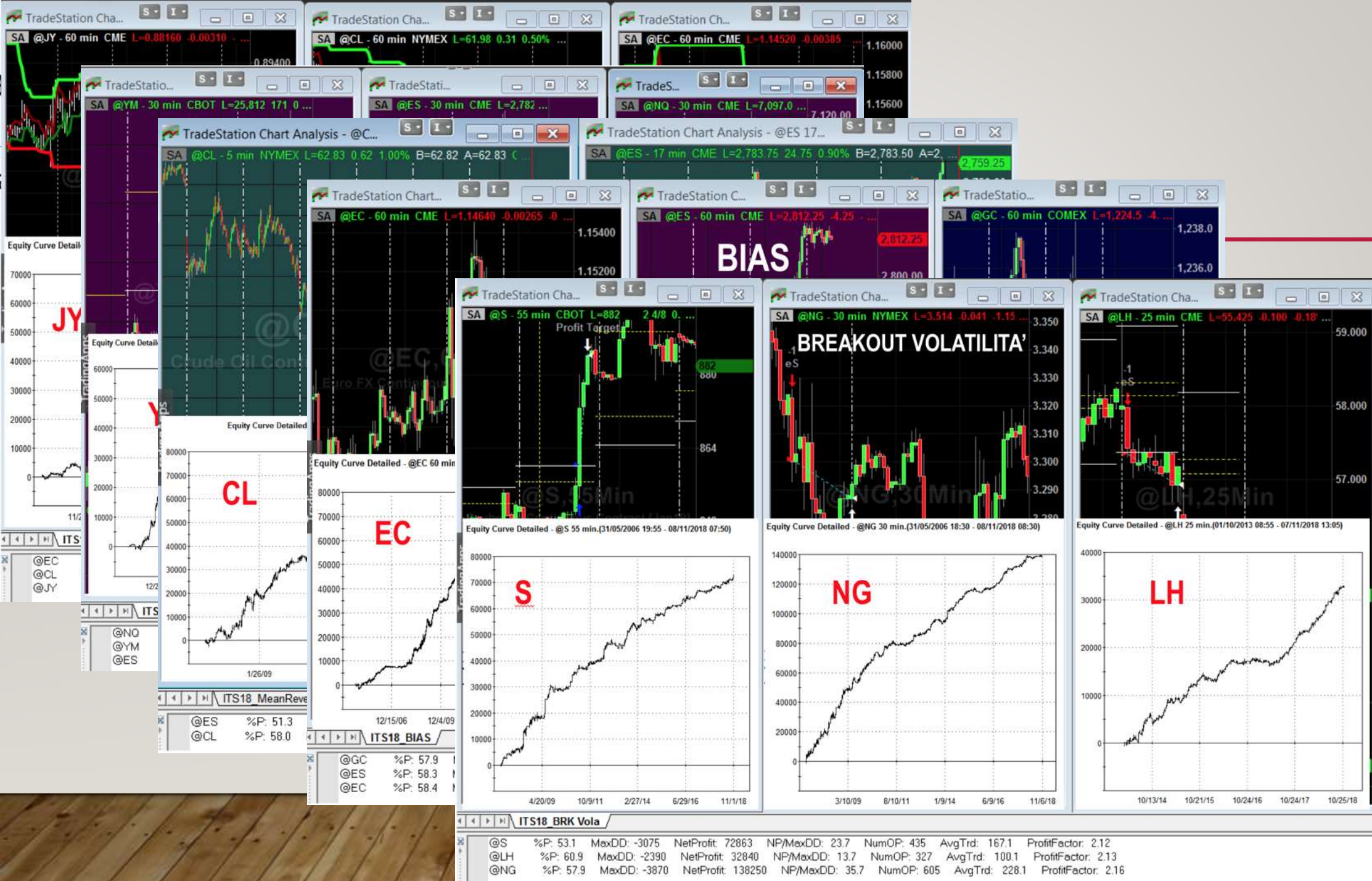
Sabato 23 Novembre

-
- 1° Classe di Trading System: **Intraday Bias**
2° Classe di Trading System: **Breakout di Livelli di Prezzo**
3° Classe di Trading System: **Breakout di Volatilità**
4° Classe di Trading System: **Intraday Mean Reverting**
5° Classe di Trading System: **Gap Trading**

14

Trading System
IntraDay







FX TRADING SYSTEMS

6 TRADING SYSTEM SUL FOREX (A CODICE APERTO)



Portfolio Builder - forex2019 [USD]

From

☒ Last System Start

☐ First System Start

Date:

14/02/2019

R

☐ Ignore Set Start

To

☐ First System Stop

☒ Last System Stop

Date:

19/02/2019

R

☐ Ignore Set Stop

Include in Computation

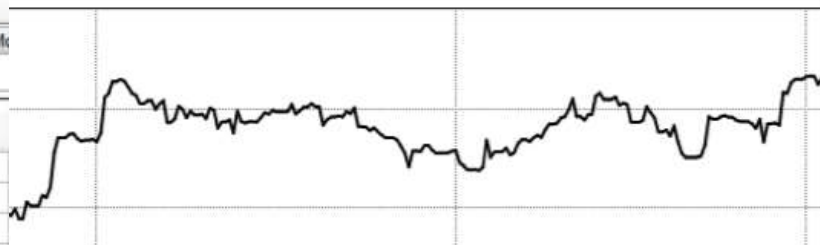
Strategy

☒ Static Weight

Main Metrics Equity Monthly Report Correlations Strategies Exposure Portfolio Exposure Rebalancing Report Portfolio Metrics

Systems Symbols Money Management Account Management Account Settings

#	Enabled	Name	Symbol	Time Shift	Side	Weight	Class	Trading Cost
1	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - Brk AUDUSD	AUDUSD	0	Both	1		0.00005 \$
2	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - Brk EURUSD	EURUSD	0	Both	1		0.00005 \$
3	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - Brk GBPUSD	GBPUSD	0	Both	1		0.00005 \$
4	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - Brk NZDUSD	NZDUSD	0	Both	1		
5	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - Brk USDCHF	USDCHF	0	Both	1		
6	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - Brk USDJPY	USDJPY	0	Both	1		
7	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - Cross AUDCAD	AUDCAD	0	Both	1		
8	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - Cross AUDNZD	AUDNZD	0	Both	1		
9	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - Cross NZDCAD	NZDCAD	0	Both	1		
10	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - RevIV AUDJPY	AUDJPY	0	Both	1		
11	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - RevIV CADJPY	CADJPY	0	Both	1		
12	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - RevIV CHFJPY	CHFJPY	0	Both	1		
13	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - RevIV GBPJPY	GBPJPY	0	Both	1		
14	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - TF EURUSD	EURUSD	0	Both	1		
15	<input checked="" type="checkbox"/>	FXTC - TimeForEvo EURUSD	EURUSD	0	Both	1		



Metric	Portfolio
Profit:	
Net Profit	349 352.5
Gross Profit	1 114 043.0
Gross Loss	- 764 690.5
Profit Factor	1.46
Total Cost	- 99 256.0
Cost / Revenue	8%
Draw Down:	
Max DD (Det)	- 6 400.5
NP / Max DD (Det)	54.6
Max DD (Peak to Valley)	- 6 755.6
NP / Max DD (Peak to Valley)	51.7
Max DD (IntraDay MAE)	- 7 124.2
Max DD (CtC)	- 6 532.5

Year	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec
2019	2 660.8	- 2 783.9	3 758.6	26.2	-	-	-	-	-	-	-	-
2018	8 054.1	1 276.7	1 638.4	- 1 016.4	2 226.7	636.2	186.0	2 827.9	4 182.5	1 503.8	- 358.3	- 1 746.3
2017	1 408.0	- 3 557.5	5 925.7	1 332.0	1 458.2	1 421.8	5 167.8	1 803.9	637.4	- 1 160.6	2 277.0	2 870.6
2016	8 086.7	4 067.6	4 843.0	- 926.3	- 111.3	1 459.5	- 1 394.2	2 671.4	2 260.8	2 554.5	4 981.5	4 989.8
2015	3 206.2	2 492.8	3 460.4	5 678.8	5 582.2	- 2 046.5	3 345.8	988.0	2 000.6	3 854.6	6 546.2	3 004.7
2014	- 3 480.4	186.8	1 272.7	5 120.2	42.3	- 1 624.4	3 712.9	- 1 755.4	4 036.7	3 041.7	- 179.4	1 883.6
2013	6 187.9	7 621.3	2 164.9	3 706.4	3 411.4	1 629.1	1 583.9	4 419.8	11 617.9	5 116.2	1 414.3	4 513.6
2012	7 381.7	5 921.6	- 1 787.9	4 042.1	7 292.7	5 640.5	673.5	2 523.7	- 901.4	1 136.7	- 1 352.0	8 786.2
2011	- 1 125.1	1 573.0	3 944.2	8 467.1	- 3 666.7	6 263.9	- 622.7	2 313.1	13 776.6	4 429.2	4 209.6	- 90.9
2010	6 605.6	7 784.0	2 204.1	3 911.8	13 047.1	2 472.4	1 906.5	6 541.9	1 479.7	2 976.3	8 443.9	3 199.5
2009	-	-	-	- 577.2	9 479.9	3 046.9	2 389.6	2 394.5	7 939.2	- 1 143.2	3 962.2	2 560.9
Avg:	3 898.6	2 458.2	2 742.4	2 705.9	3 876.2	1 889.9	1 694.9	2 472.9	4 703.0	2 230.9	2 994.5	2 997.2

ANALISI DELLE CORRELAZIONI FRA VALUTE PER OPERARE SU FX

FX TRADING SYSTEMS

13 + 20 Nov.
(2 serate, 4+4 ore
collegati a distanza)

6 TRADING SYSTEMS
A CODICE APERTO

COME ABBIAMO SCELTO DI FARE FORMAZIONE

- Puoi seguirlo in **SALA** oppure **COLLEGATO A DISTANZA**
- In entrambi mettiamo a disposizione la **REGISTRAZIONE**
- Inviamo sempre **PRIMA tutto il materiale e la Registrazione** dell'edizione precedente
- Il corso si può **RIFREQUENTARE** tutte le volte che vuoi
- Il corso NON finisce in aula: a distanza di un paio di settimane c'è il **Webinar del “DOPO CORSO”**, hai a disposizione un **FORUM** dove puoi fare domande, e puoi vedere le nostre operazioni accedendo ai **“SEGNALI OPERATIVI”** *(dalla Teoria alla Pratica)*



...noi lavoriamo così



NULLA E' PER SEMPRE...

- Le Strategie possono smettere di funzionare...
- E nessuna tecnica di **Validazione** (=stress test) potrà mai darti la GARANZIA al 100% che questo trading system non smetterà di funzionare
- ...ma solo perché NON ho questa GARANZIA al 100%, non significa che NON valga la pena effettuate dei test sulla propria strategia, per individuarne delle FRAGILITA' (e scartarla...)



I TEST TRADIZIONALI

- ...è semplice?
- ...funziona su una porzione di dati che non ha mai visto? (OOS)
- ...funziona su più mercati?
- ...“regge” anche per diversi valori dei parametri impiegati?
- ...è in grado di superare una Walk Forward Analysis?



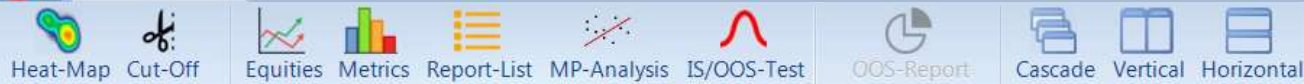
GLI ALTRI TEST CHE EFFETTUIAMO SULLA STRATEGY LAB



- ...**misuriamo la PERSISTENZA** del Risultato fra IS/OOS del motore grezzo (MPI)
- ...Analisi Segnale/Rumore (**confronto delle distribuzioni dei trade IS/OOS**)
- ...Analisi di Stabilità dei parametri su **Heat Maps Multi-Dimensionali** (non blocchiamo gli altri parametri) e **confronto Aree di Stabilità IS/OOS**
- ...Iniezione di **Rumore Artificiale** sulla serie storica per monitorare il degrado della strategia



Functionalities



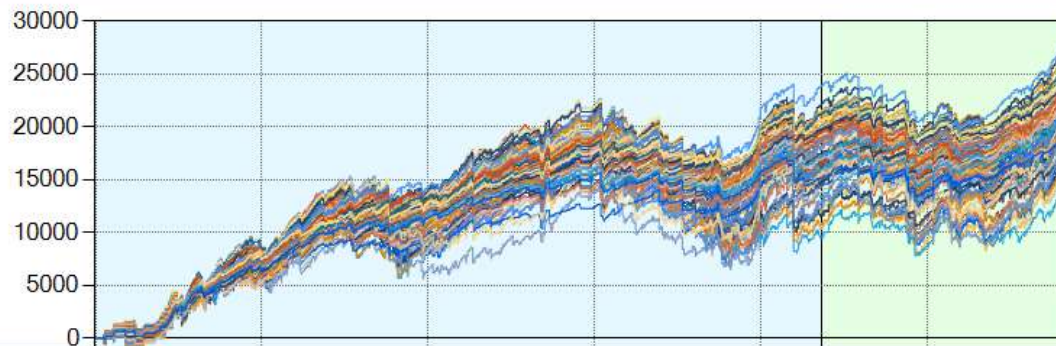
Domain Management

Data Visualisation

Out Of Sample

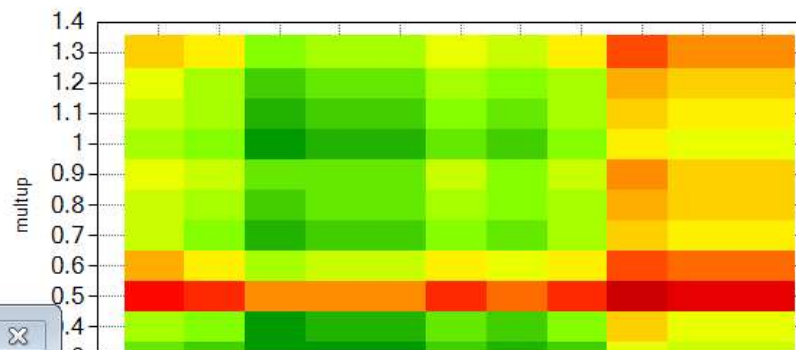
Windows

Equities - ID: 1



Heat Map - ID: 2

Net Profit (Average)



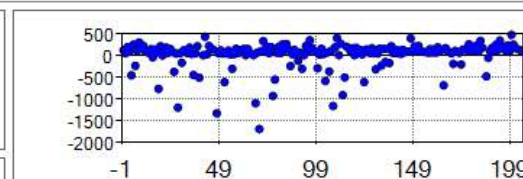
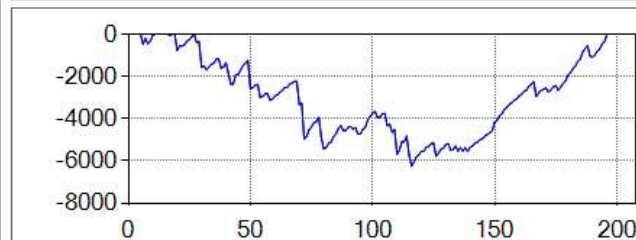
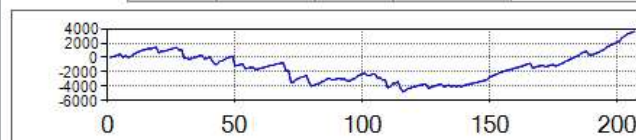
Performance Report - ID: 5 - BP

Equity Metrics TradesList Monthly Report Charts TradesAnalysis Equity Control Trade Dependency Monte Carlo Input Layout

Stop Rule 1	And Rule 2	And Rule 3	And Rule 4	Restart Rule 1	And Rule 2	And Rule 3	And Rule 4

Execute Add ☐ Monte Carlo 100

Comparison Included Excluded Control Monte Carlo

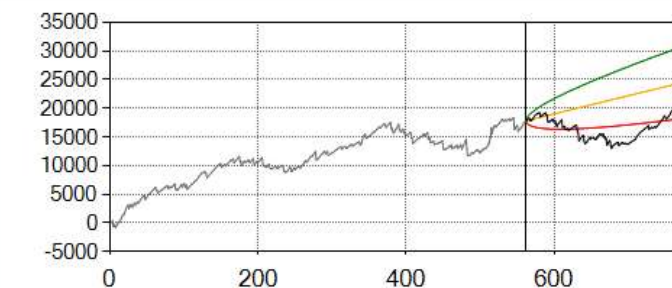


Metric	Original	Controlled
Net Profit	3 637.5	3 637.5
Profit Fa...	1.19	1.19
DD	-6 243.8	-6 243.8
NP / DD	0.6	0.6

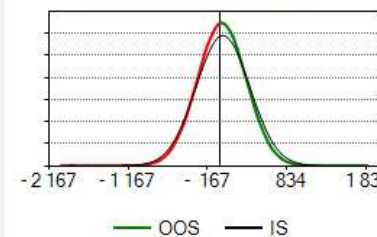
Assumptions

☐ Assume Same Variance

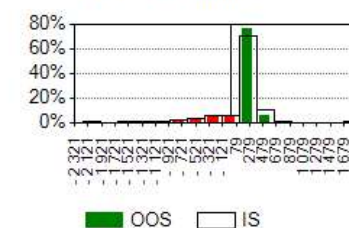
Confidence: 90.0 %



Gaussian Fit of Trades



Trades Histogram



TRADING AUTOMATICO

Sabato 9 Novembre



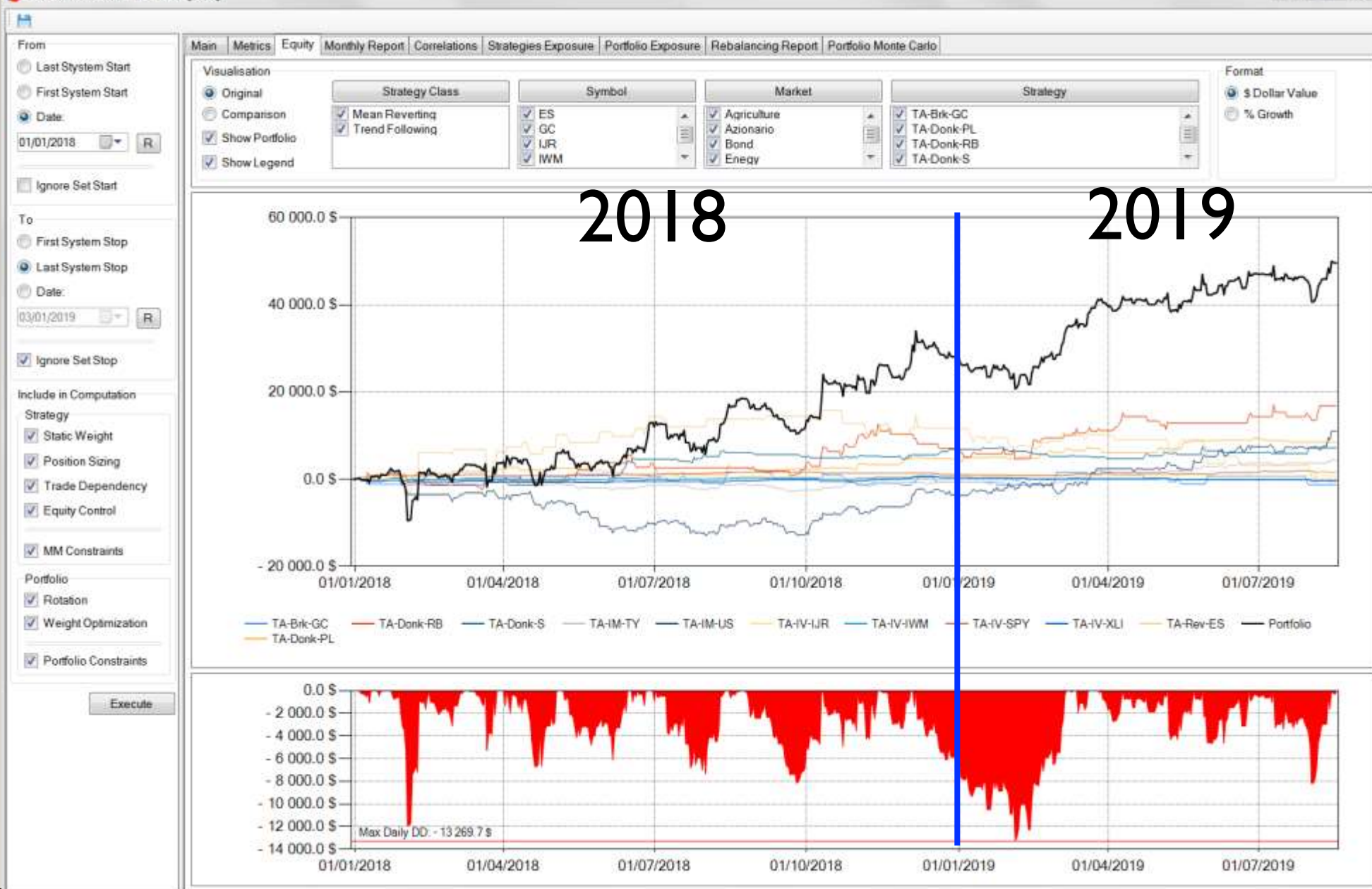
- 1) Un sistema basato sulla **Volatilità Implicita**
- 2) Una Strategia **Trend Following**
- 3) Un sistema di tipo **Breakout** su Gold Future
- 4) Un sistema **Reversal** (*mean reverting*)
- 5) Una Strategia **InterMarket** (*e un template per creare Trading System Intermarket*)

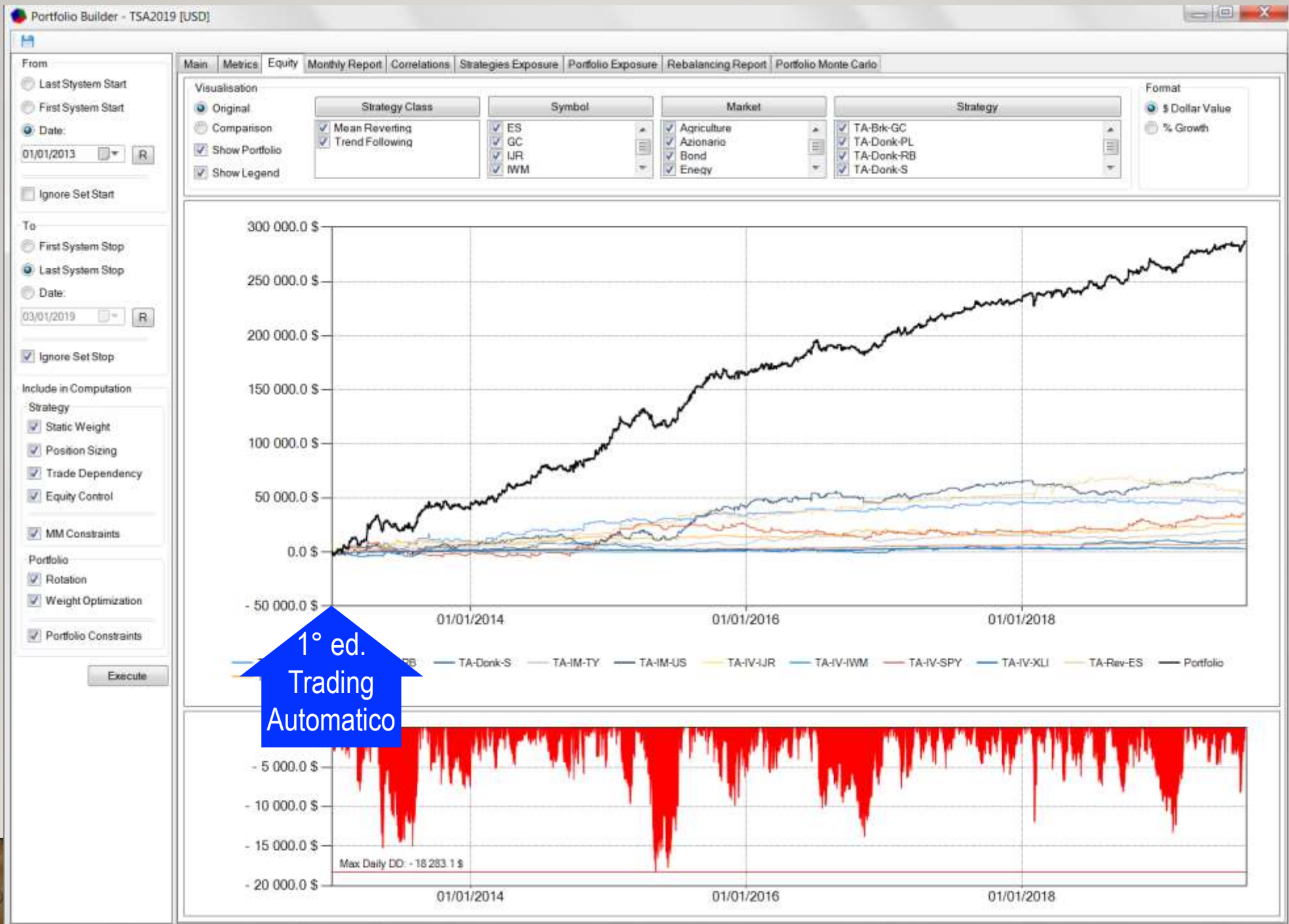
**LA VALIDAZIONE DI
UNA STRATEGIA E LA
MISURAZIONE DELLA
SUA ROBUSTEZZA**

11

**Trading System
Multi-Day**







11

+

14

= 25

Trading System
(a **codice aperto**)



COMPILA QUESTO VOLATINO, PER AVERE DIRITTO A:

☐ La Strategia di oggi sul FIB e le SLIDE

[SCRIVI IL TUO NOME, TEL. E INDIRIZZO EMAIL IN STAMPATELLO LEGGIBILE]

GRATIS

☐ Trading **Automatico** (9 Novembre)

(11 Trading Systems per imparare a Validare e a costruire strategie Robuste)

-20%

797€

(invece di 997€)

☐ Intra-Day Trading System (23 Novembre)

(14 Trading Systems da cui partire per costruire e Validare altre strategie Intraday)

-20%

797€

(invece di 997€)

☐ FX Trading Systems (13 + 20 Novembre, *collegato a distanza*)

(6 Trading System per sfruttare Correlazioni, BIAS e le specificità del Forex)

-30%

697€

(invece di 997€)

☐ Opzioni + Futures (30 Nov.) + 3 Mesi Segnali Strangle

(5 protocolli Short Strangle con Difesa Meccanica sul Future sottostante)

-50%

797€

(invece di
997+590= 1587€)



UN PORTFOGLIO CON I TRADING SYSTEM DEI CORSI DELLA TRADING SYSTEM ACADEMY

Main	Metrics	Equity	Monthly Report	Correlations	Strategies Exposure	Portfolio Exposure	Rebalancing Report	
Systems	Symbols	Money Management	Account Management	AccountSettings				
#	Enabled	Name	Symbol	Time Shift	Side	Weight	Class	Trading Cost
1	<input type="checkbox"/>	ITS-Bias-EC	EC	0	Both	1	Bias	10.00 \$
2	<input type="checkbox"/>	ITS-Bias-ES	ES	0	Both	1	Bias	10.00 \$
3	<input type="checkbox"/>	ITS-Bias-GC	GC	-1	Both	1	Bias	15.00 \$
4	<input type="checkbox"/>	ITS-BrkP-CL	CL	-1	Both	1	Trend Following	15.00 \$
5	<input type="checkbox"/>	ITS-BrkP-EC	EC	0	Both	1	Trend Following	10.00 \$
6	<input type="checkbox"/>	ITS-BrkP-JY	JY	0	Both	1	Trend Following	10.00 \$
7	<input type="checkbox"/>	ITS-Gap-CL	CL	-1	Both	1	Gap	15.00 \$
8	<input type="checkbox"/>	ITS-Gap-ES	ES	0	Both	1	Gap	10.00 \$
9	<input type="checkbox"/>	ITS-MR-ES	ES	0	Both	1	Mean Reverting	10.00 \$
10	<input type="checkbox"/>	ITS-MR-NQ	NQ	0	Both	1	Mean Reverting	10.00 \$
11	<input type="checkbox"/>	ITS-MR-YM	YM	0	Both	1	Mean Reverting	10.00 \$
12	<input type="checkbox"/>	ITS-VolaBRK-LH	LH	0	Both	1	Break Out	15.00 \$
13	<input type="checkbox"/>	ITS-VolaBRK-NG	NG	-1	Both	1	Break Out	15.00 \$
14	<input type="checkbox"/>	ITS-VolaBRK-S	S	0	Both	1	Break Out	15.00 \$
15	<input checked="" type="checkbox"/>	TA-Brk-GC	GC	-1	Both	1	Trend Following	15.00 \$
16	<input checked="" type="checkbox"/>	TA-Donk-PL	PL	-1	Both	1	Trend Following	10.00 \$
17	<input checked="" type="checkbox"/>	TA-Donk-RB	RB	-1	Both	1	Trend Following	15.00 \$
18	<input checked="" type="checkbox"/>	TA-Donk-S	S	0	Both	1	Trend Following	15.00 \$
19	<input checked="" type="checkbox"/>	TA-IM-TY	TY	0	Both	1	Trend Following	15.00 \$
20	<input checked="" type="checkbox"/>	TA-IM-US	US	0	Both	1	Trend Following	15.00 \$
21	<input checked="" type="checkbox"/>	TA-IV-IJR	IJR	-1	Both	1	Mean Reverting	0.01 \$
22	<input checked="" type="checkbox"/>	TA-IV-IWM	IWM	-1	Both	1	Mean Reverting	0.01 \$
23	<input checked="" type="checkbox"/>	TA-IV-SPY	SPY	-1	Both	1	Mean Reverting	0.01 \$
24	<input checked="" type="checkbox"/>	TA-IV-XLI	XLI	-1	Both	1	Mean Reverting	0.01 \$
25	<input checked="" type="checkbox"/>	TA-Rev-ES	ES	0	Both	1	Mean Reverting	10.00 \$



Do You Speak Easy Language?



Trading Automatico



ITS- Intraday Trading System

TRADING SYSTEM ACADEMY



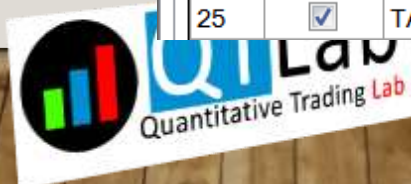
Trading Systems & Money Management



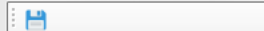
Portafogli di Trading System



Weekend di Workshop



X 2



From

☐ Last System Start

☐ First System Start

☒ Date:

01/01/2018 R

☐ Ignore Set Start

To

☐ First System Stop

☒ Last System Stop

☐ Date:

03/01/2019 R

☒ Ignore Set Stop

Include in Computation

Strategy

☒ Static Weight

☒ Position Sizing

☒ Trade Dependency

☒ Equity Control

☒ MM Constraints

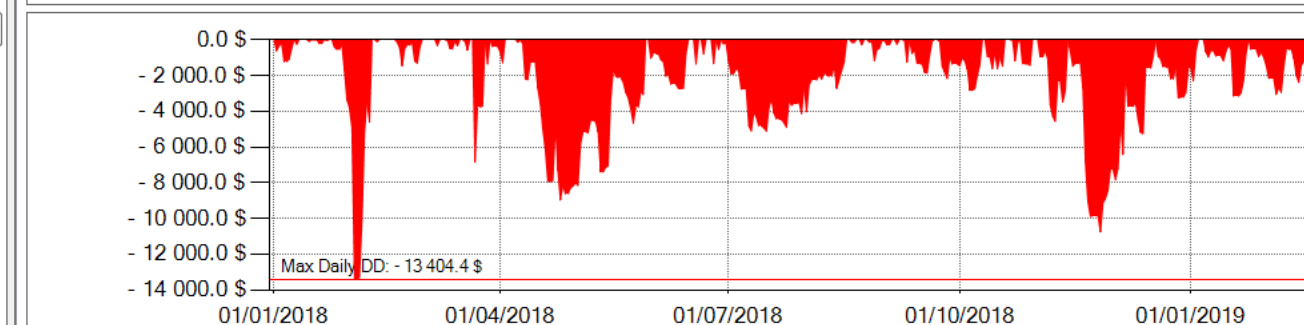
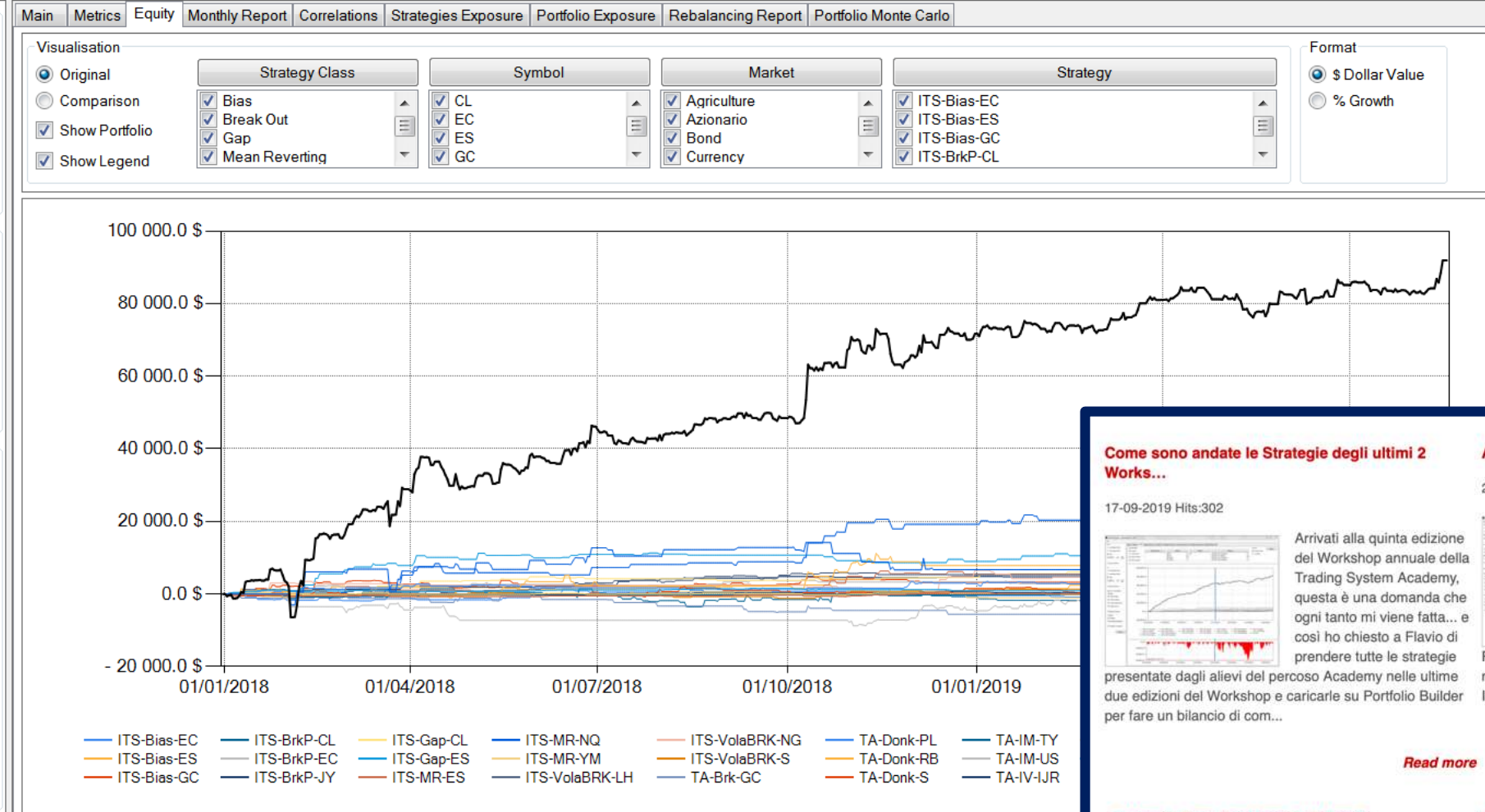
Portfolio

☒ Rotation

☒ Weight Optimization

☒ Portfolio Constraints

Execute



Il Portafoglio
delle **25** Strategie
della Trading
System Academy
(con un sistema di
controllo sull'Equity
basato sul Avg Trade)

Come sono andate le Strategie degli ultimi 2 Works...

17-09-2019 Hits:302



Arrivati alla quinta edizione del Workshop annuale della Trading System Academy, questa è una domanda che ogni tanto mi viene fatta... e così ho chiesto a Flavio di prendere tutte le strategie presentate dagli allievi del percorso Academy nelle ultime due edizioni del Workshop e caricarle su Portfolio Builder per fare un bilancio di com...

[Read more](#)

Anatomia di un Portafoglio (2ª parte)

20-08-2019 Hits:649



Nella prima parte dell'articolo (che puoi leggere cliccando qui) ho già anticipato che avrei parlato di un secondo accorgimento che potremmo adottare per migliorare le prestazioni del Portafoglio dove ho inserito tutte e 25 le strategie che mettiamo a disposizione nei corsi Trading Automatico e IntraDay Trading Systems che fanno pa...

[Read more](#)

Anatomia di un Portafoglio (1ª parte)

19-08-2019 Hits:948



Nell'ultimo aggiornamento, ai primi di Aprile 2019 (che puoi riprendere cliccando qui), l'equity line del Portafoglio composto dai Trading System del percorso Trading System Academy (25 strategie) aveva segnato un nuovo massimo: è tempo di aggiornare la situazione, ripartendo proprio da dove ci siamo lasciati, 4 mesi fa. Questa è l'equi...

3) Un Trading System su Crude OIL (a codice aperto...

05-06-2019 Hits:2620

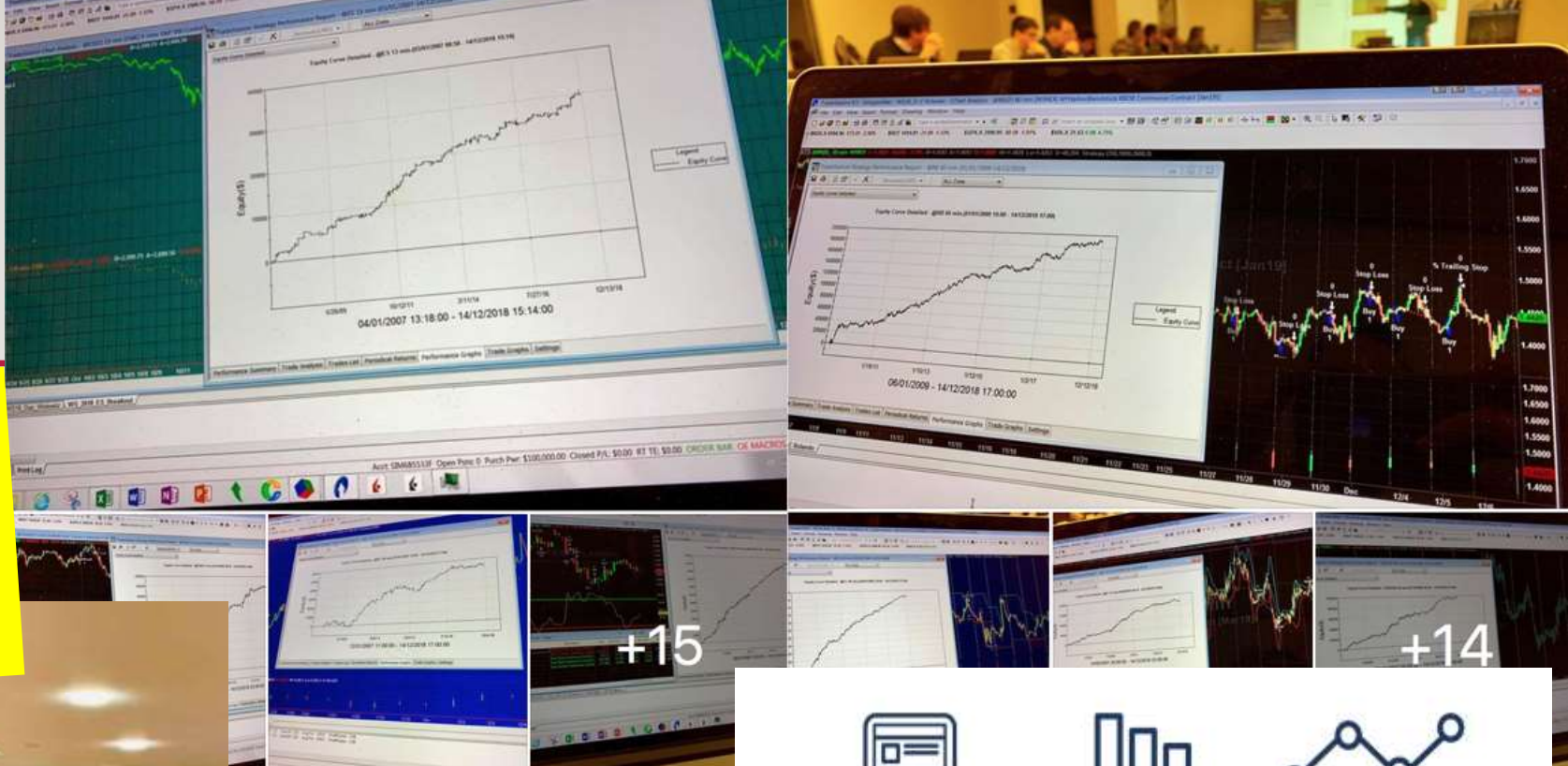


Il Crude Oil è un mercato molto versatile: accanto al tradizionale contratto Future, esiste anche un Mini Future (ticker: QM) piuttosto liquido (con un controvalore dimezzato). Il Crude Oil, inoltre, è una Commodity che offre molteplici opportunità di lavoro per un trader sistematico: è possibile intercettare dei br...

WORKSHOP

DELLA TRADING SYSTEM ACADEMY

...L'OBIETTIVO E'
IMPARARE A CREARNE
ALTRI, IN AUTONOMIA!



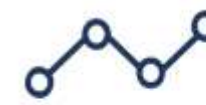
COME SONO ANDATE
LE STRATEGIE CREATE
DAGLI ALLIEVI
DELL'ACADEMY?



Do You Speak
Easy Language?



Trading
Automatico



ITS- Intraday
Trading System

TRADING SYSTEM
A C A D E M Y



Trading Systems &
Money Management

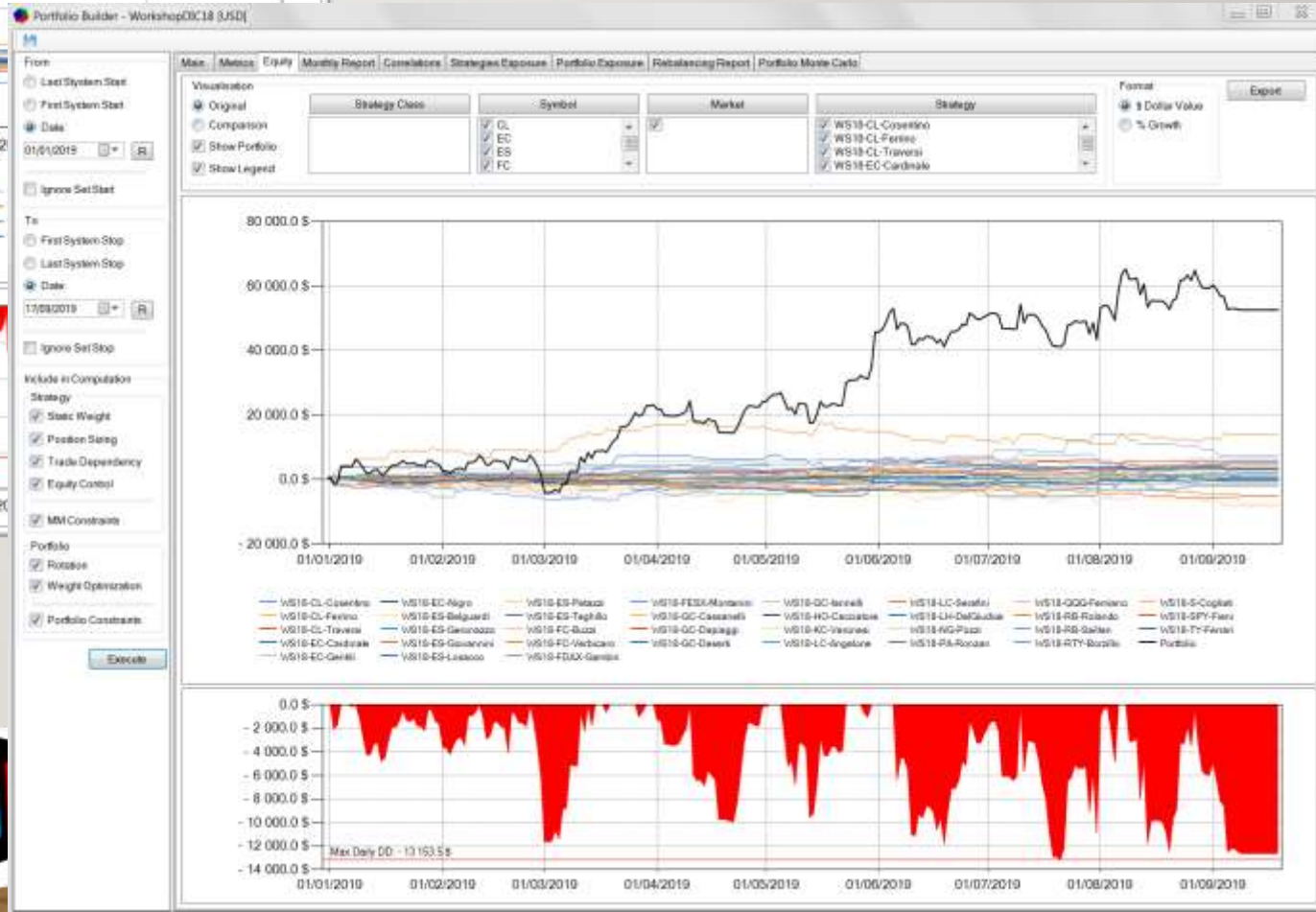
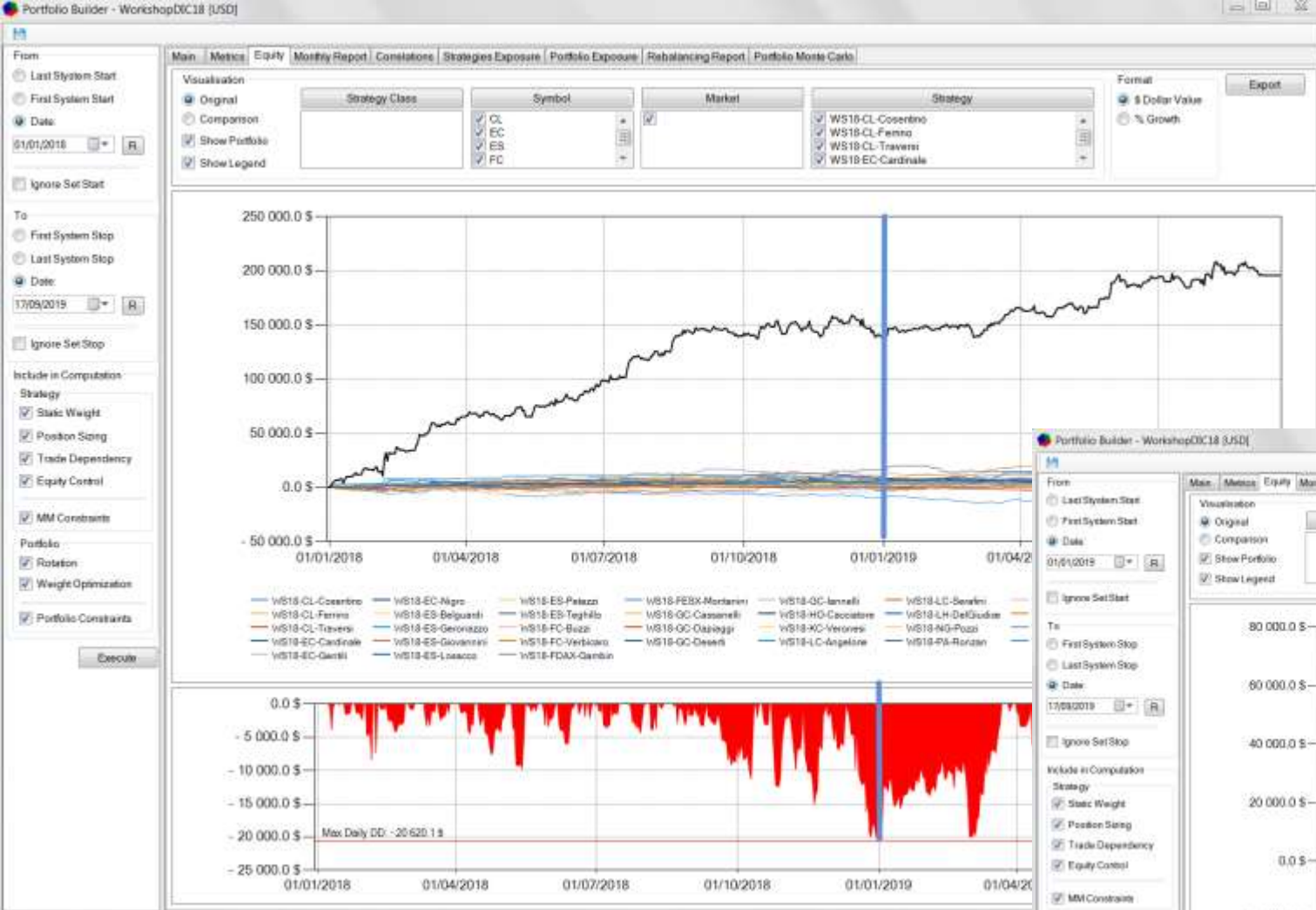


Portafogli di
Trading System



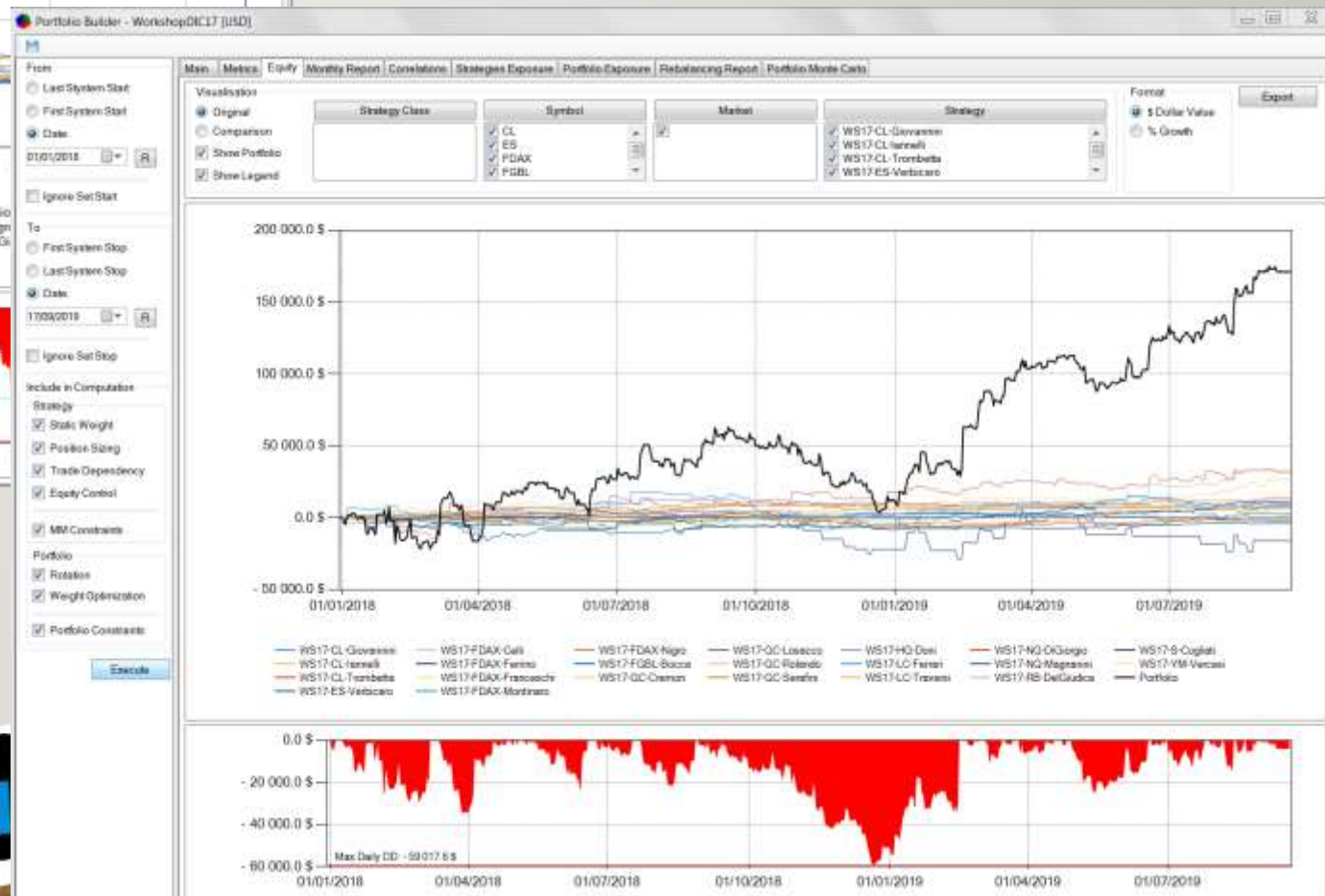
Weekend di
Workshop

LE STRATEGIE DEGLI ALLEVI DELL'ACADEMY AL **WORKSHOP 2018**





LE STRATEGIE DEGLI ALLEVI DELL'ACADEMY AL **WORKSHOP** 2017





❌ Trading System Academy

- Easy Language (3 serate: 16 e 24 Ottobre e 7 Novembre)
- Trading Automatico (9 Novembre)
- IntraDay Trading System (23 Novembre)
- Trading Systems & Money Management (14 Dicembre)
- Portafogli di Trading Systems (18 Gennaio)
- Workshop (Gennaio 2020)
- 8 Webinars (50 ore di video)

6994€ **3497 €**

[-3500€]

...è una riduzione del
-50%

Puoi seguire i corsi in SALA oppure **COLLEGATO A DISTANZA** e mettiamo sempre a disposizione la **REGISTRAZIONE** integrale della giornata. Inviando sempre PRIMA tutto il materiale e la Registrazione dell'edizione precedente (i trading system sono con CODICE APERTO). Il corso si può RIFREQUENTARE tutte le volte che vuoi. A distanza di un paio di settimane c'è il Webinar del "DOPO CORSO". Hai a disposizione un FORUM oppure puoi chiamare un NUMERO Italiano per ricevere supporto, e puoi vedere le nostre operazioni accedendo ai **SEGNALI OPERATIVI**.

COGNOME.....

TEL.....

☐ Autorizzo il trattamento dei dati "Cognome" "Tel" "Email" in base all'art. 13 del D. Lgs. 196/2003 e all'art. 13 GDPR 679/16.

FIRMA:

EMAIL.....

- 50 %

8 Giornate di Formazione, che puoi seguire **in sala** oppure **collegato a distanza**, la **Registrazione** subito disponibile, la **Rifrequenza** Gratuita, **25** Trading System (a codice aperto), **4** Webinar Live per rispondere alle tue domande, **8** Webinar Registrati, le Dispense e il Materiale didattico, un Weekend di **Workshop**



I PROSSIMI APPUNTAMENTI...

13 Novembre: **FX TRADING SYSTEMS**
2 SERATE

21 Novembre: **EASY LANGUAGE ADVANCED**
4 SERATE

9 Novembre: **TRADING AUTOMATICO**

30 Novembre: **OPZIONI + FUTURES**

16 Novembre: **TRADING MECCANICO SUL VIX**

1 Dicembre: **SHORT STRANGLE ADVANCED**

23 Novembre: **INTRADAY TRADING SYSTEMS**



PUOI PROSEGUIRE IL LAVORO INIZIATO OGGI, CON DELLE RIDUZIONI IMPORTANTI

RICORDATI DI **CONSEGNARCI**
IL MODULO, **COMPILATO** CON:

IL **CORSO**/I CHE HAI SCELTO
E I **TUOI DATI** (IN STAMPATELLO)



COMPILA QUESTO VOLATINO, PER AVERE DIRITTO A:

<input checked="" type="checkbox"/> La Strategia di oggi sul FIB e le SLIDE <small>[SCRIVI IL TUO NOME, TEL. E INDIRIZZO EMAIL IN STAMPATELLO LEGGIBILE]</small>	GRATIS
<input type="checkbox"/> Trading Automatico (9 Novembre) <small>(11 Trading Systems per imparare a Validare e a costruire strategie Robuste)</small>	-20% 797€ <small>(invece di 997€)</small>
<input type="checkbox"/> Intra-Day Trading System (23 Novembre) <small>(14 Trading Systems da cui partire per costruire e Validare altre strategie Intraday)</small>	-20% 797€ <small>(invece di 997€)</small>
<input checked="" type="checkbox"/> FX Trading Systems (13 + 20 Novembre, <i>collegato a distanza</i>) <small>(6 Trading System per sfruttare Correlazioni, BIAS e le specificità del Forex)</small>	-30% 697€ <small>(invece di 997€)</small>
<input type="checkbox"/> Opzioni + Futures (30 Nov.) + 3 Mesi Segnali Strangle <small>(5 protocolli Short Strangle con <u>Difesa Meccanica</u> sul Future sottostante)</small>	-50% 797€ <small>(invece di 997+590= 1587€)</small>
<input type="checkbox"/> Trading System Academy <ul style="list-style-type: none">- Easy Language (3 serate: 16 e 24 Ottobre e 7 Novembre)- Trading Automatico (9 Novembre)- IntraDay Trading System (23 Novembre)- Trading Systems & Money Management (14 Dicembre)- Portafogli di Trading Systems (18 Gennaio)- Workshop (Gennaio 2020)- 8 Webinars (50 ore di video)	6994€ 3497€ [-3500€] ...è una riduzione del -50%

Puoi seguire i corsi in SALA oppure COLLEGATO A DISTANZA e mettiamo sempre a disposizione la REGISTRAZIONE integrale della giornata. Inviamo sempre PRIMA tutto il materiale e la Registrazione dell'edizione precedente (i trading system sono con CODICE APERTO). Il corso si può RIFREQUENTARE tutte le volte che vuoi. A distanza di un paio di settimane c'è il Webinar del "DOPO CORSO". Hai a disposizione un FORUM oppure puoi chiamare un NUMERO Italiano per ricevere supporto e puoi vedere le nostre operazioni accedendo ai SEGNALI OPERATIVI.

COGNOME.....	TEL.....	SCRIVI IN STAMPATELLO!
<input type="checkbox"/> Autorizzo il trattamento dei dati "Cognome" "Tel" "Email" in base all'art. 13 del D. Lgs. 196/2003 e all'art. 13 GDPR 679/16.		EMAIL.....
FIRMA:		

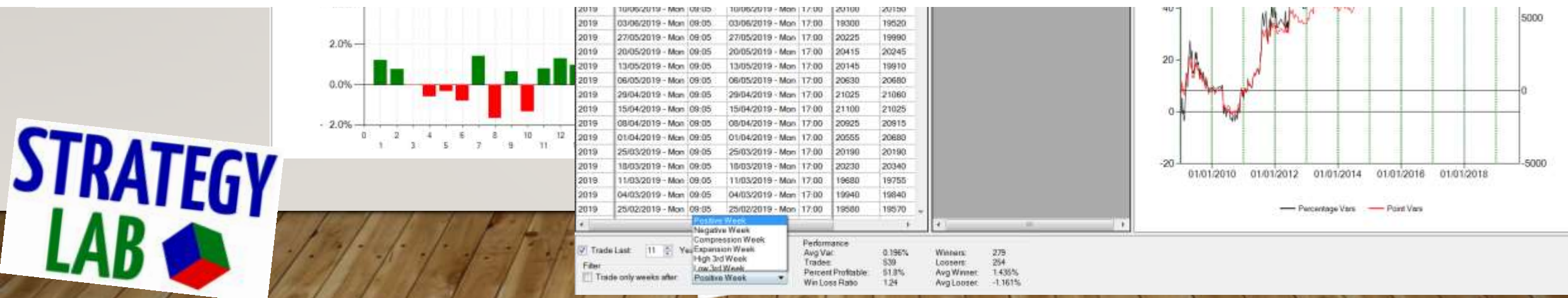


DATA
ANALYZER

597€

Licenza LifeTime

(SOLO PER QUESTA SETTIMANA)



Milano, 23 e 24 ottobre 2019

Trading Online Expo



GRAZIE

WWW.QTLAB.CH

INFO@QTLAB.CH

SKYPE: QTLAB.CH

