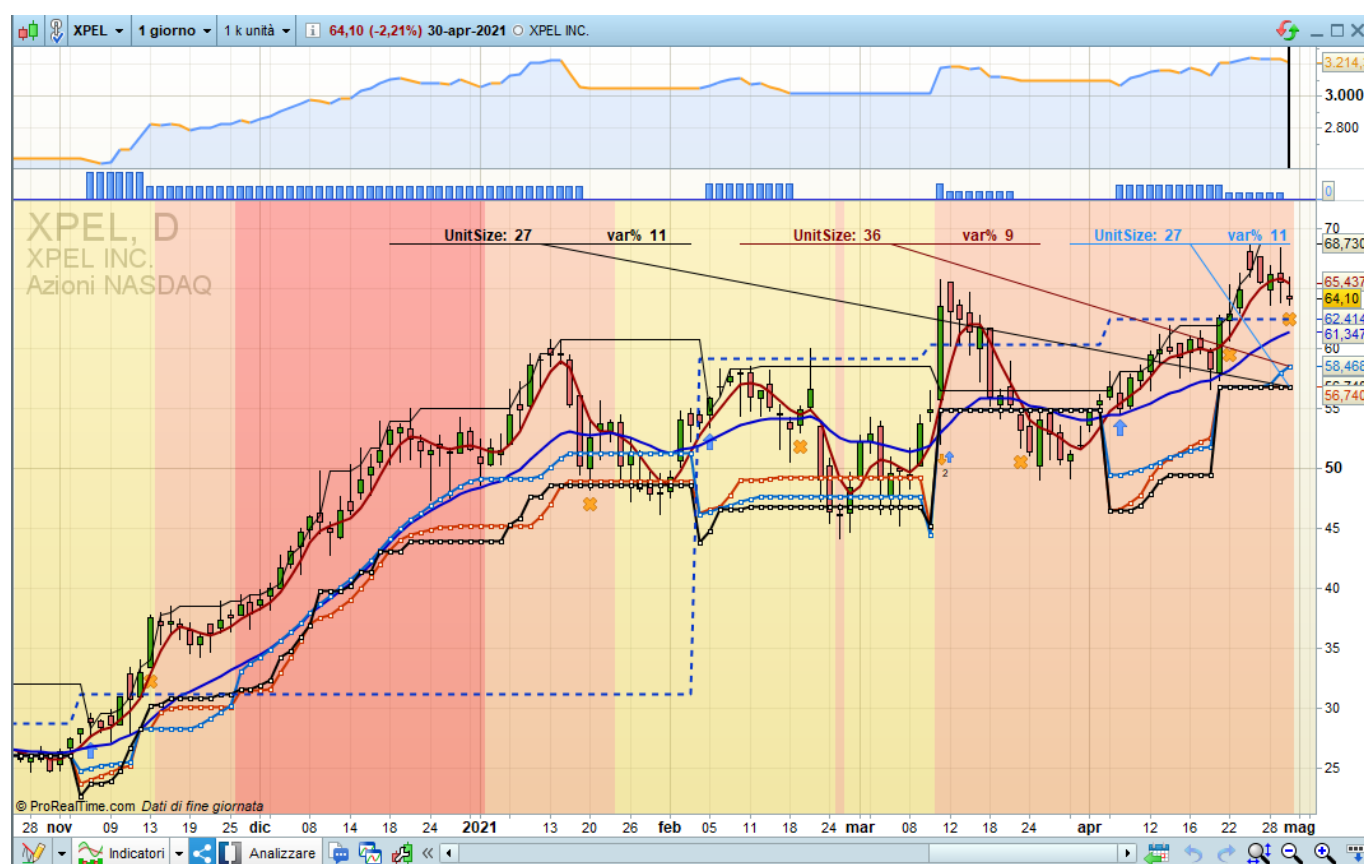


ALMA + EMA Adattivo LayOut

Realizzare un Trading System che attui una nostra strategia non è sufficiente, è sempre buona norma creare anche degli indicatori che rappresentino i criteri ed i segnali del nostro sistema di trading. Avere l'indicatore relativo al Trading System ci consente di monitorarne il funzionamento cercando eventuali correzioni o miglioramenti da inserire nel codice.

E' altresì utile quando operiamo manualmente sul mercato. Avere disponibili velocemente le informazioni su dove andar a posizionare lo Stop Loss è vitale per il mantenimento della posizione, così com'è importante vedere quanti titoli negoziare e quando farlo.

L'indicatore ALMA + EMA Adattivo LayOut rappresenta graficamente tutti i criteri della strategia alla base del Trading System TS ALMA + EMA Adattivo.



L'indicatore può essere configurabile in base alle proprie esigenze sia di visualizzazione che di calcolo dei livelli di Stop Loss e di Money Management.

Nella seguente figura sono elencati tutte le variabili su cui potete intervenire al fine di personalizzare il funzionamento dell’indicatore.

Proprietà - Prezzo

Modalità di visualizzazione

Aggiungi Indicatore | Aggiungi una Zona di Colore | Duplica | Eliminare

Prezzo
Ord. eseg.
ALMA+EMA MultiAdattivo LayOut (200 t t 0 0.01 3 t 9 21 1 30 200 10 2 9 2 30 30 10 20)
TS ALMA+EMA MultiAdattivo
Scala
Zone di colore (0)
Impostazioni grafico

☒ ALMA+EMA MultiAdattivo LayOut Configurazione: Senza nome*

MaxLoss: 200 ☒ flagBackGround
☒ flagInfo offsetX: 0
offsetY: 0.01 TipoStopLoss: 3
☒ flagResistenza PeriodoALMA: 9
PeriodoEMA: 21 TipoMedia: Esponenziale
PeriodoSTD: 30 PeriodoStorico: 200
soglia: 10 MultiploRisk: 2
PeriodoMedia: 9 PeriodoFast: 2
PeriodoSlow: 30 PeriodoLR: 30
MaxProfit: 10 EffettoNoe: 20
Applica a: Chiusura

Linea	Colore	Spessore	Stile	Etichetta
☒ ALMA	Rialzo Ribasso			☒ Misura +0
☒ Media Mobile	Rialzo Ribasso			☒ Misura +0
☒ Stop Loss Adattivo	Rialzo Ribasso			☒ Misura +0
☒ Stop Loss LR	Rialzo Ribasso			☒ Misura +0
☒ Effetto Noè	Rialzo Ribasso			☒ Misura +0
☒ Prezzo Target	Rialzo Ribasso			☒ Misura +0
☒ Resistenza	Rialzo Ribasso			☒ Misura +0

Descrizione delle variabili dell’indicatore:

Varibile	Descrizione
MaxLoss	Rappresenta la massima perdita di capitale che siamo disposti a perdere in ogni operazione
flagBackGround	È il flag di abilitazione/disabilitazione della visualizzazione sul grafico dell’andamento della volatilità, modifica il colore dello sfondo in base all’aumentare della componente rischio.
flagInfo	È il flag di abilitazione/disabilitazione della visualizzazione sul grafico del numero di azioni da tradare e della variazione percentuale tra l’ultimo prezzo di chiusura del titolo ed il raggiungimento del livello di Stop Loss.
offsetX	Permette di spostare da destra a sinistra e viceversa le informazioni visualizzate
offsetY	Permette di spostare in alto ed in basso e viceversa le informazioni visualizzate
TipoStopLoss	Identifica il metodo di calcolo dello Stop Loss scegliendo tra Stop Loss Adattivo, Stop Loss su Regressione Lineare e Stop Loss su Effetto Noè

flagResistenza	È il flag di abilitazione/disabilitazione della visualizzazione sul grafico dell'ultimo massimo fatto registrare dal prezzo del titolo durante il segnale di apertura posizione rialzista
PeriodoALMA	Identifica il numero di barre utilizzate per generare la Media Mobile ALMA
PeriodoEMA	Identifica il numero di barre per generare la Media Mobile Esponenziale
TipoMedia	Identifica quale Media Mobile utilizzare per verificare il trend del prezzo di un titolo
PeriodoSTD	Rappresenta il numero di barre con cui calcolare la <i>Deviazione Standard</i>
PeriodoStorico	Rappresenta il numero di barre da considerare per identificare il valore massimo ed il valore minimo fatto registrare dalla <i>Deviazione Standard</i>
soglia	Rappresenta la distanza, in valore percentuale, <i>Deviazione Standard</i> dal suo valore massimo fatto registra durante il PeriodoStorico analizzato
MultiploRisk	Rappresenta il valore iniziale del coefficiente moltiplicativo da applicare alla <i>Deviazione Standard</i> per calcolare il livello di Stop Loss
PeriodoMedia	Rappresenta il numero di barre per generare la Media Mobile Adattiva
PeriodoFast	Rappresenta il numero di barre per la componente veloce della Media Mobile Adattiva
PeriodSlow	Rappresenta il numero di barre per la componente lenta della Media Mobile Adattiva
PeriodoLR	Rappresenta il numero di barre per generare calcolare la Regressione Lineare
MaxProfit	Identifica la percentuale di profitto che viene utilizzata per effettuare la vendita parziale della posizione rialzista
Effetto Noè	Identifica la variazione percentuale di ribasso del prezzo del titolo con cui calcolare lo Stop Loss

Tramite la finestra proprietà dell'indicatore sarà possibile personalizzare i segnali dell'operatività della strategia, adeguandola alle proprie esigenze oppure adeguandola ad eventuali risultati di ottimizzazioni personalizzate.

Abbiamo detto più volte che non esistono metodi unici che funzionano meglio di altri, così come non possiamo asserire che esistano configurazioni standard che diano risultati ottimali. Questo significa che ognuno può provare a testare la strategia ottimizzando non solo il metodo di calcolo dello Stop Loss, bensì agendo sulla massima perdita (MaxLoss) oppure sulla percentuale per identificare la vendita Parziale (MaxProfit) o su quella per identificare l'Effetto Noè e così via.

Una volta che avrete effettuato i vostri test, le vostre ottimizzazioni sarà semplice monitorarle sul grafico grazie all'indicatore che dovrete aggiornare con i valori che estrarrete dall'applicativo ProBackTest.

ALMA + EMA Adattivo Index

Un altro strumento utile per facilitare la nostra operatività sul mercato è dato da un indicatore che evidenzia i momenti cruciali della nostra strategia, che ci fornisca velocemente ed in modo chiaro quali sono le azioni da compiere.

A questo scopo abbiamo realizzato l'indicatore *ALMA + EMA Adattivo Index* il quale andrà aggiunto sotto il grafico dei prezzi in modo da ottenere il piano di lavoro come quello mostrato in figura.



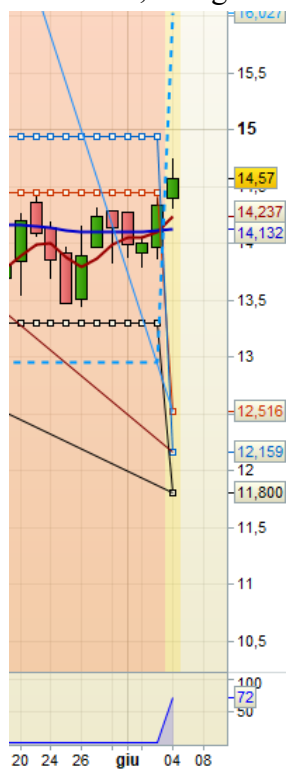
Come per l'indicatore *ALMA + EMA Adattivo LayOut* anche questo indicatore può essere configurabile a piacere. Ovviamente è bene sottolineare che sia il Trading System che i due indicatori devono essere configurati con gli stessi valori in modo da non dare segnali fuorvianti.

☒ **ALMA+EMA MultiAdattivo Index** [f. Modifica](#) Configurazione: Senza nome* [+](#)

MaxLoss	200	TipoStopLoss	3
PeriodoALMA	9	PeriodoEMA	21
TipoMedia	Esponenziale	PeriodoSTD	30
PeriodoStorico	200	soglia	10
MultiploRisk	2	PeriodoMedia	9
PeriodoFast	2	PeriodoSlow	30
PeriodoLR	30	MaxProfit	10
EffettoNoe	20	Applica a	Chiusura

Colore	Spessore	Stile	Etichetta
Rialzo			☒ Misura +0
Ribasso			

Il nuovo indicatore avrà quindi il compito di segnalare quando aprire una posizione rialzista sul titolo analizzato, il segnale sarà quando, alla chiusura della l'ultima barra del prezzo, l'indicatore assumerà un valore maggiore di zero.



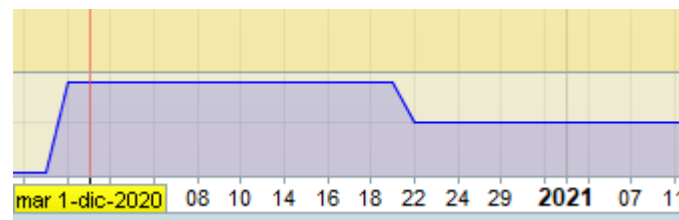
Al verificarsi delle condizioni di apertura di una posizione l'indicatore assumerà il valore di quante azioni dovremo acquistare

Il numero di azioni da negoziare viene calcolato in base alla perdita massima che siamo disposti a conseguire per proteggere il nostro investimento.

Dal punto di vista operativo quando ci troveremo nella situazione mostrata in figura sapremo che dovremo impostare un ordine d'acquisto al meglio per 72 azioni.

Grazie all'indicatore *ALMA + EMA Adattivo LayOut* avremo anche l'indicazione di dove posizionare lo Stop Loss di protezione.

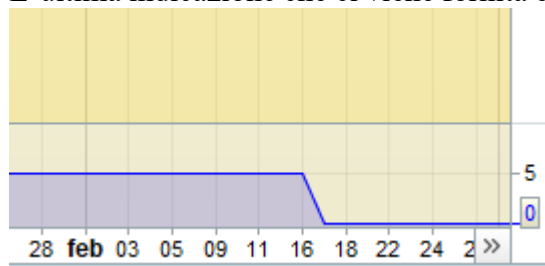
Un'altra funzione dell'indicatore *ALMA + EMA Adattivo Index* è quella di segnalare quando il prezzo del titolo su cui abbiamo investito ha raggiunto il prezzo target.



La strategia *TS ALMA + EMA Adattivo* prevede che al raggiungimento del prezzo target vengano vendute metà delle azioni possedute in modo da consolidare una prima parte di profitto.

Il segnale sarà dato quando l'indicatore assumerà un valore inferiore rispetto al valore assunto al verificarsi delle condizioni di apertura della posizione rialzista. L'indicatore assumerà il valore pari alla metà del numero di azioni possedute.

L'ultima indicazione che ci viene fornita è quella relativa alla chiusura della posizione rialzista che avremo quando il valore dell'indicatore sarà pari a 0 (zero titoli da detenere in portafoglio).



Al verificarsi delle condizioni di chiusura della posizione dovremo impostare un ordine di vendita al meglio di tutte le azioni possedute.