SERVIZIO "LAST MINUTE"

by Team Sviluppo Sistemi Algoritmica.pro Srl

Il servizio "Last Minute Ftse Mib" è a cura del "Team Sviluppo Sistemi" di Algoritmica.pro Srl, una società attiva nello sviluppo, programmazione, valutazione di strategie quantitative per trader sistematici privati ed istituzionali.

Il sistema intraday[1] è basato sul Future[2] del FTSE MIB e possiede le seguenti caratteristiche:

- Metodologia: trend-following
- Time frame: 15 minuti
- Capitale[3]: 15.000,00 €

Questo trading system[4] intraday può essere sfruttato anche in ottica di portafoglio multi-mercato. Si tratta di un sistema trend follower la cui logica è di facile comprensione: il sistema determina attraverso un filtro proprietario la tendenza del giorno in corso e nel caso vi sia alta probabilità di prosecuzione, effettua un ingresso a mercao alle 16.00 in punto. Il trade[5] viene aperto a mercato (con ordine *at* market) proprio in apertura della barra delle 16:00. Essendo un sistema intraday, nel caso non vengano raggiunto lo stop loss (non possiede target profit), chiude le posizioni a fine giornata.

Sui futures può essere adattato anche sui seguenti indici:

- ES (S&P500).

Software di analisi tecnica per i backtest e l'esecuzione dei report: Multicharts

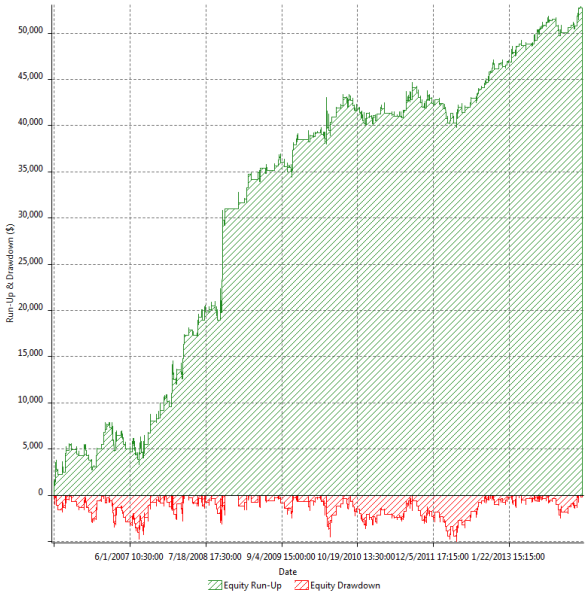
Il servizio "Last Minute Ftse Mib" non prevede l'ottimizzazione periodica degli inputs[6].

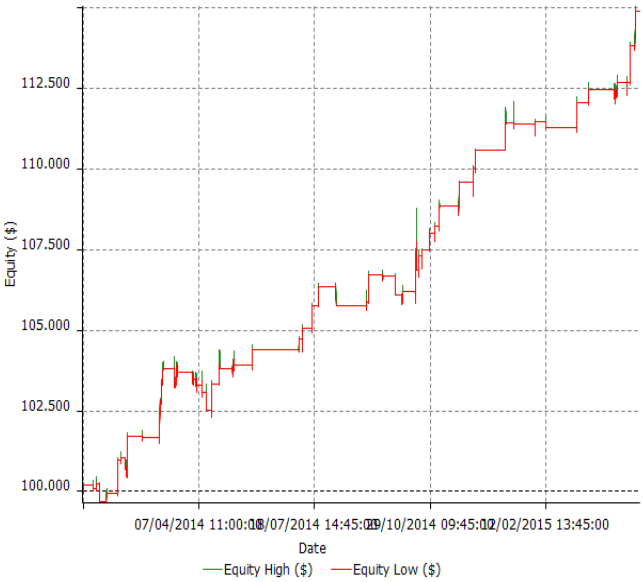
<u>Nel corso del 2015 (da gennaio a fine maggio) il sistema sul Ftse Mib ha avuto un rendimento di +5.305,00 € (si veda a pagina 3 l'analisi del sistema ed i performance report allegati).</u>

---

[1] Strategia che prevede la chiusura di tutte le posizioni aperte entro fine giornata.
[2] Contratti a termine standardizzati per poter essere facilmente scambiati in Borsa. Acquistare futures significa impegnarsi ad acquistare alla scadenza ed al prezzo prefissati il sottostante (attività reali e finanziarie)..
[3] Capitale di trading minimo consigliato.
[4] Un trading system è la codificazione (in un linguaggio di programmazione) di una strategia di trading che viene applicata dal computer generando automaticamente i segnali di acquisto e vendita in base all'evolversi del mercato.
[5] Operazione di acquisto e/o vendita di uno strumento finanziario
[6] Le combinazioni differenti degli inputs indicano differenti livelli di stop loss e profit target tra i vari sottostanti.

Equity line storica e dell'ultimo anno di backtest ed alcuni screenshots del performance report:





Period	Profit		Gross Profit	Gross Loss	# Trades	% Profitable
	$	%				
05/2015	$1045	0,92%	$1045	$0	1	100%
04/2015	$1375	1,22%	$1535	($160)	5	60%
03/2015	$1190	1,07%	$1190	$0	2	100%
02/2015	($110)	(0,1%)	$70	($180)	2	50%
01/2015	$790	0,71%	$845	($55)	2	50%
12/2014	$1015	0,93%	$1015	$0	2	100%
11/2014	$1340	1,24%	$1340	$0	2	100%
10/2014	$2145	2,02%	$2720	($575)	7	85,71%
09/2014	$335	0,32%	$940	($605)	4	50%
08/2014	($575)	(0,54%)	$0	($575)	1	0%
07/2014	$1930	1,85%	$1930	$0	4	100%
06/2014	$0	0%	$0	$0	0	0%
05/2014	$585	0,56%	$615	($30)	3	66,67%
04/2014	$280	0,27%	$1335	($1055)	7	42,86%
03/2014	$1870	1,84%	$2830	($960)	7	57,14%
02/2014	$1215	1,21%	$1245	($30)	2	50%
01/2014	$265	0,26%	$1505	($1240)	7	57,14%
12/2013	$195	0,19%	$195	$0	1	100%

Period	Profit ($)	Gross Profit	Gross Loss	# Trades	% Profitable
2014	1830	2950	-1120	9	55.56
2013	4495	9930	-5435	40	67.50
2012	3562.5	10342.5	-6780	40	60.00
2011	1837.5	9927.5	-8090	40	42.50
2010	2547.5	12900	-10352.5	43	46.51
2009	7455	13235	-5780	29	62.07
2008	20880	30380	-9500	39	48.72
2007	4570	16180	-11610	51	47.06
2006	5452.5	11400	-5947.5	27	55.56

Analisi del sistema

Il capitale iniziale utilizzato per il back-test è 15.000,00 € con un l'investimento di 1 contratto future.

Tutti i back-test sono stati eseguiti al netto di commissioni[7] e slippage[8], quindi sono inclusi i costi operativi ipotetici e la consistenza del sistema è stata verificata con l'ottimizzazione wfa, essendo un sistema con un basso numero di operazioni (circa 40 operazioni medie annuali). Il guadagno medio per trade pari a 165,50 € (al netto dei costi operativi), molto capiente se si pensa al tempo che il sistema resta a mercato (non più di un'ora e mezza).

Massimo drawdown di 4.985,00 €; percent profitable[9] del 53,14% e profit factor[10] di 1,81.

Modalità di fruizione del servizio

Gli abbonati al servizio ricevono il codice in un formato protetto per la piattaforma di trading MultiCharts. Pertanto gli abbonati possono caricare il trading system direttamente sulla propria piattaforma. In alternativa, o in aggiunta al codice, gli abbonati possono richiedere l'attivazione del servizio sms/email alert per conoscere in tempo reale la posizione teorica del fornitore. Sono previsti inoltre invii periodici dei performance report aggiornati.

I costi del servizio in abbonamento: mensile 167,00€ | annuale 1670,00€

Per **maggiori informazioni** potete chiedere un appuntamento con un Responsabile del Team di sviluppo all'indirizzo info@algoritmica.pro oppure al numero di rete fissa +39 051 3760999.

Team Sviluppo Sistemi

Algoritmica.pro Srl

ATTENZIONE: esiste un significativo rischio di perdita attraverso la compravendita di Futures. L'utilizzo di stop loss non garantisce in nessun modo la limitazione delle perdite.
I PERFORMANCE REPORT SONO IPOTETICI E SIMULATI, PERTANTO HANNO DELLE LIMITAZIONI INTRINSECHE. ALLO STESSO MODO I PERFORMANCE REPORT NON RAPPRESENTANO IL TRADING REALE.

N.B. I trading systems sono basati su precise regole matematiche, che tuttavia non possono garantire in nessun modo la continuità dei profitti e delle perdite medie sui trade futuri, poiché attraverso lo studio del trading sistematico si opera nel campo delle probabilità e non delle certezze.

Nota per ISTITUZIONALI ed AZIENDE: trattativa e pricing da concordare.

[7] Il costo dovuto al broker per l'esecuzione della transazione finanziaria.
[8] La differenza tra l'eseguito del trade teorico e quello reale. Ad esempio, se il sistema acquistasse a 100, ma il broker eseguisse a 101 otterremmo uno slippage di 1 = 101-100.
[9] Il rapporto tra il numero di trade vincenti e quelli perdenti
[10] Il rapporto tra il gross profit (profitto lordo) e il gross loss (perdite lorde)