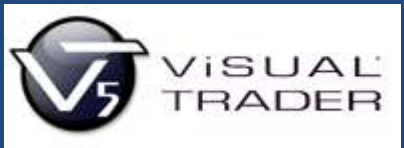
La palestra di Visual Trader: per raggiungere l'eccellenza nel trading

Milano 17 Novembre 2007



Disclaimer/Note Legali

Le opinioni espresse in questa presentazione e seminario non intendono in alcun modo costituire un invito a porre in essere qualsiasi transazione che implichi l'acquisto la vendita di azioni, contratti future, opzioni, fondi o qualsiasi altro strumento finanziario.
Non rappresentano perciò in alcun modo una sollecitazione del pubblico risparmio o consulenza all'investimento.

I rischi di perdite legati all'attività di trading possono essere molto elevati.

L'investitore deve considerare attentamente i rischi inerenti all'attività di trading e investimento alla luce della propria situazione finanziaria.
Questa presentazione ha solo scopi educativi e informativi. Leggendo i contenuti di questa presentazione e assistendo al seminario, si riconosce la propria responsabilità nell'uso delle informazioni e ci si impegna a consultare un consulente finanziario professionista prima di un eventuale utilizzo o implementazione delle stesse.

Tutto il materiale proposto è protetto dalle leggi sul diritto d'autore: © copyright 2007 profste® - marchio registrato

Chi è Traderlink?

- Traderlink è una **software house** specializzata in **servizi di erogazione dati di Borsa** su Internet. Nasce a Rimini nel 1996.
- Strutturata per lo sviluppo di tecnologie avanzate, è la prima che trasferisce i dati del CED Borsa di Milano in tempo reale su web.
- In occasione del suo decennale ha presentato una versione completamente rinnovata di Visual Trader

Cos’è Visual Trader?

- E’ il prodotto di punta di TraderLink dedicato all'utente finale.
- E’ il software piu' avanzato sviluppato in Italia per quanto riguarda la gestione di flussi di **dati in tempo reale**, differiti, storici, analisi, report, **analisi tecnica personale**, fondi comuni di investimento,etc.
- Il software Visual Trader e' utilizzato da numerose strutture bancarie, clientela privata, promotori finanziari, sim, etc.
- Visual Trader e' in continua evoluzione, e costituisce la punta avanzata dello sviluppo tecnologico di TraderLink, sia per quanto riguarda il software che per l’affidabilità dei server che lo alimentano.

Cos’è VT5?

- Visual Trader e' stato completamente rinnovato e ristrutturato in occasione del decennale di Traderlink.
- **VT 5** è piu' bello, chiaro e semplificato, grazie all'innovativa interfaccia grafica, e anche molto più potente e funzionale grazie alle numerosissime funzionalità implementate.
- Il nuovo **VT 5** è molto leggero rispetto alla precedente versione; impegna fino al 40% in meno di CPU, permettendo prestazioni ottime anche su hardware meno potenti.
- Sul sito troverete tutte le novità di VT5 e una prova gratuita di 15 giorni.

Stefano Bargiacchi - PROFSTE

Trader Professionista e Formatore

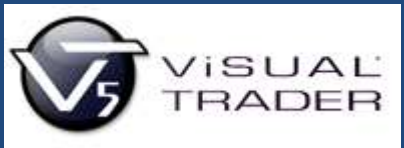
Email: profste@gmail.com

Sito: cercare PROFSTE su Google

profste

TRADING LIBRARY

Chi siete voi?



PRIMA PARTE
La simulazione come elemento centrale della strategia di trading

Il trading come attività imprenditoriale

Quali sono i COSTI?

Quali sono i RICAVI?

Il trading come attività imprenditoriale

COSTI:

- Istruzione,
- PC,
- connessione internet,
- software,
- fornitura dati,
- commissioni,
- slippage,
- tasse su capital gain,
- tempo (costo opportunità) ,
- perdite,
- stress emotivo
- altri costi…

Il trading come attività imprenditoriale

RICAVI:

- profitti,
- libertà (per i trader full time),
- risparmi commissionali,
- risparmi in costi di gestione patrimoniale,
- soddisfazione e realizzazione personale,
- accresciuta conoscenza e cultura finanziaria,
- altri ricavi…

Il trading come attività imprenditoriale

PROBLEMA:
i COSTI sono ANTICIPATI e certi
mentre i RICAVI sono POSTICIPATI e incerti

Ne conseguono gli
obiettivi da tenere presenti durante il periodo
di apprendimento.

Il trading come attività imprenditoriale

SOLUZIONE:
contenere i costi
contenere i costi
contenere i costi

Sui costi abbiamo una piena possibilità di controllo, sui ricavi no.

Il trading come attività imprenditoriale

ESEMPI DI CONTENIMENTO DEI COSTI:
PC, hardware, connessione a internet,
commissioni e slippage,
ma soprattutto…

RIPETIAMO IL NOSTRO PRIMO OBIETTIVO COME TRADER:

CONTENIMENTO DEI COSTI
(anticipati e certi), specie nei periodi di apprendimento e di *riapprendimento*, al fine di sopravvivere agli stessi per poter poi giungere al conseguimento dei Ricavi (posticipati e incerti)

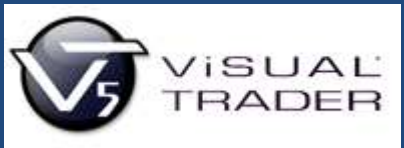
Il contenimento dei costi deve essere
un elemento essenziale del nostro business plan.

Evitiamo però quei risparmi che possono portare a perdite elevate.

Esempi di *falsi* risparmi:

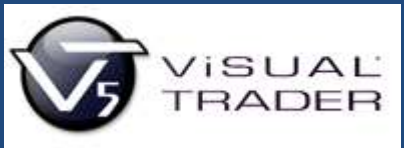
- costi di istruzione e apprendimento;
- tick in entrata e uscita dalle posizioni in presenza di forti segnali;
- connessioni realtime poco affidabili;
- altri falsi risparmi.

non dobbiamo MAI essere
penny wise e dollar fool



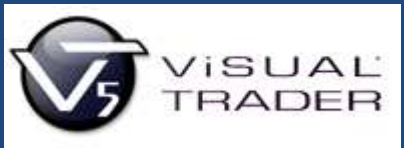
Il trading come attività basata sulla performance

La pratica e l’allenamento come
elemento essenziale
della formazione nelle attività basate sulla
performance



Allenarsi non è solo fare paper trading!

Il simulatore di VT è la nostra arma vincente



Chi sono le nostre controparti?
Chi vende mentre noi compriamo e perché lo fa?
Chi compra quando noi vendiamo e perché lo fa?

Perché è importante allenarsi sul simulatore di VT5?

Chi sono le nostre controparti?
Chi vende mentre noi compriamo e perché lo fa?
Chi compra quando noi vendiamo e perché lo fa?

le immagini sono state reperite da internet e ritenute di pubblico dominio secondo ampia giurisprudenza internazionale

TRADING LIBRARY

profste

VISUAL TRADER

le immagini sono state reperite da internet e ritenute di pubblico dominio secondo ampia giurisprudenza internazionale

TRADING LIBRARY

profste

VISUAL TRADER

le immagini sono state reperite da internet e ritenute di pubblico dominio secondo ampia giurisprudenza internazionale

TRADING LIBRARY

profste

VISUAL TRADER

le immagini sono state reperite da internet e ritenute di pubblico dominio secondo ampia giurisprudenza internazionale

TRADING LIBRARY

profste

VISUAL TRADER

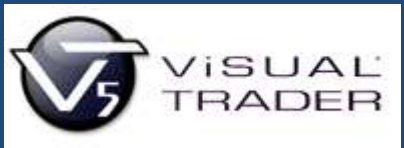
le immagini sono state reperite da internet e ritenute di pubblico dominio secondo ampia giurisprudenza internazionale

TRADING LIBRARY

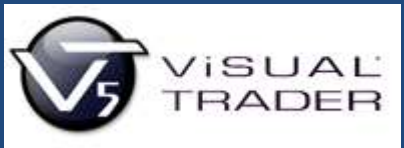
profste

VISUAL TRADER

Qual è il problema nel trading rispetto alle altre discipline?



Fin dal nostro primo trade le nostre controparti sono i migliori professionisti al mondo.



E’ necessario quindi porsi in tutta onestà i seguenti quesiti:

- Quando abbiamo fatto il nostro primo trade eravamo preparati?
- Quando abbiamo fatto il nostro primo trade sapevamo chi erano le nostre controparti?
- Potevamo pensare di riuscire contro di loro?
- Le probabilità di successo sono in nostro o loro favore?

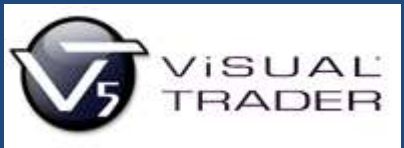
Gli stessi quesiti si pongono anche per l’ultimo trade che abbiamo fatto.

TRADING LIBRARY
profste
VISUAL TRADER

Aver scoperto di essersi trovati sui mercati con una preparazione inadeguata non è un dramma, anzi rappresenta un momento formativo essenziale.

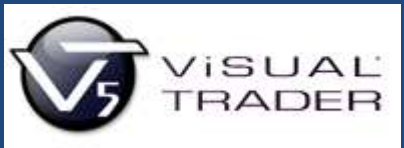
Il primo passo verso la soluzione di un problema sta nella sua identificazione

Ok, ho capito tutto, ma la soluzione qual è???



La soluzione sta nella **pratica costante** e nell'**allenamento**, esattamente come fanno i campioni dello sport.

Questo è ciò che separa i dilettanti dai professionisti.



Il simulatore di Visual Trader permette di allenarsi esattamente come fanno i professionisti.

Il simulatore di Visual Trader può essere utilizzato in RealTime

Esempi di utilizzo del simulatore nelle *proprietary trading firm.*

Il simulatore di Visual Trader permette di allenarsi
esattamente come fanno i professionisti.

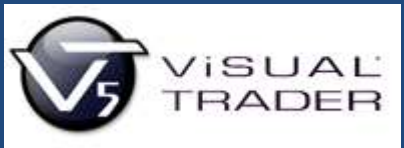
Il simulatore di Visual Trader può essere utilizzato in RealTime e in EoD

Esempi di utilizzo del simulatore nelle *proprietary trading firm* e nelle Investment Bank.

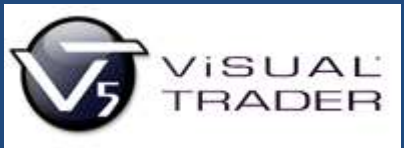
Il simulatore di Visual Trader può essere utilizzato:

- in RealTime, per simulare la performance a mercati aperti;
- in Replay, per rivedere intere giornate o periodi alla moviola;
- nelle due modalità possiamo testare e ritestare le nostre strategie;
- il nostro capitale (elemento vitale) è sempre al riparo dagli errori.

Il simulatore di Visual Trader è il nostro campo pratica dove ogni giorno ci alleniamo,
provando e riprovando le nostre strategie,
fino a raggiungere la preparazione necessaria per affrontare i mercati.



Esempi di utilizzo del simulatore nelle *proprietary trading firm* nell'addestramento dei trader professionisti.



L’allenamento come percorso verso l’*eccellenza* nel trading:

- Quali obiettivi porsi?
- Come misurare i propri progressi?
- Quale dev’essere il *benchmark* da battere?
- La simulazione deve impegnarci come e più del trading reale?

I nostri primi obiettivi da perseguire saranno quindi:

- l'individuazione della propria collocazione nell'arena del trading;
- la determinazione del proprio metodo o sistema di trading;
- la scelta tra trading discrezionale e/o sistematico;
- la determinazione dei mercati sui quali operare;
- la determinazione del timeframe sul quale operare.

Gli obiettivi da perseguire inizialmente (*paper trading*) saranno quindi:

- l'individuazione della propria collocazione nell'arena del trading;
- la determinazione del proprio metodo o sistema di trading;
- la scelta tra trading discrezionale e/o sistematico;
- la determinazione dei mercati sui quali operare;
- la determinazione del timeframe sul quale operare.

Come raggiungerli?

- La ricerca attraverso la pratica della propria area di attività operativa;
- il *paper trading* e la simulazione;
- *trial and error* con esperimenti sui possibili mercati e timeframe;
- la sperimentazione di diversi metodi e pattern.

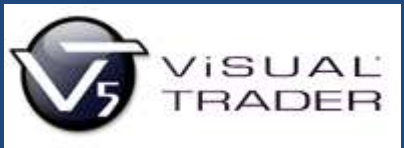
Gli obiettivi da perseguire successivamente (*simulazione*) saranno quindi:

- la specializzazione;
- il perfezionamento della tecnica e dell'esecuzione;
- il controllo delle prestazioni;
- la profittabilità;
- la consistenza.

La simulazione come elemento essenziale della formazione

- La simulazione realistica come attività distinta dal *paper trading*;
- la chiave vincente è l'utilizzo di se stessi come *benchmark;*
- il superamento del problema psicologico della simulazione;
- il monitoraggio della performance attraverso il diario giornaliero dove far confluire il report di VT di ciascuna sessione.

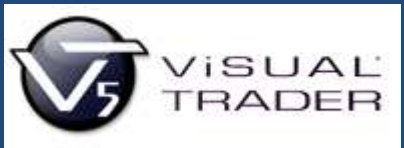
La simulazione come elemento del riapprendimento



Cos’è accaduto nel marzo 2000 a chi ha iniziato a fare trading poco prima?

Cos’è accaduto dall’Agosto 2007 a oggi?

Come adattare le nostre metodologie ai mercati durante l’attuale crisi creditizia?



Elemento essenziale della nostra strategia è la gestione del cambiamento:

- Anche i trader professionisti e profittevoli sperimentano periodi di perdite;
- i mercati cambiano ed è necessario adattare il nostro metodo di trading;
- i trader di successo come gestori del cambiamento personale e dei mercati;
- il processo di *riapprendimento* e il simulatore come suo elemento essenziale.

Un periodo di perdite è il segnale che deve attivare il processo di riapprendimento.

È necessario individuare i motivi che hanno innescato le perdite:

- Possono essere cambiati i mercati;
- può essere quindi necessario modificare la nostra strategia;
- possiamo essere cambiati noi;
- può essere quindi necessario adattare il nostro approccio ai mercati.

Non sono solo le perdite a dover innescare il processo di riapprendimento:

- Il trader deve fare della ricerca e dell'apprendimento un processo continuo;
- il trading è assimilabile ad un percorso evolutivo senza fine;
- lo studio e la ricerca devono accompagnare ogni fase dello stesso;
- esempi di percorsi evolutivi in termini di mercati e timeframe.

SECONDA PARTE
La palestra di Visual Trader

Gli obiettivi da porsi nella pratica effettuata attraverso la simulazione:

- la copertura dei costi (*break even trader*);
- la consistenza (*consistent trader*);
- la profittabilità (*profitable trader*).

Feedback :

- profste@hotmail.com: per domande commenti, critiche e suggerimenti;
- info@tradingprofessionale.it: per domande sull'organizzazione dei corsi di profste;
- paola.fabbri@traderlink.it 0549/ 900.757: per richiedere corsi su VT, tenuti da profste.

Grazie a tutti voi per aver partecipato a questo seminario.