

LEZIONE 2 – DATI, BROKER E PRIMA ANALISI DI UN TRADING SYSTEM

DR. ANDREA ANGIOLINI
ALGORITMICA.PRO SRL

VERSIONE DI MULTICHARTS

Quale versione utilizziamo? Questa è una domanda molto importante... ed ha risposte differenti a seconda del luogo in cui deve essere installata. Un conto è il server di trading, un conto è il pc con cui si eseguono i test.

DATA FEED E BROKER

Partiamo distinguendo «Data Feed» da «Broker».
Sebbene in molteplici casi le due figure corrispondano (ad esempio tradando direttamente sul grafico del broker), per MultiCharts **si tratta di due elementi differenti.**

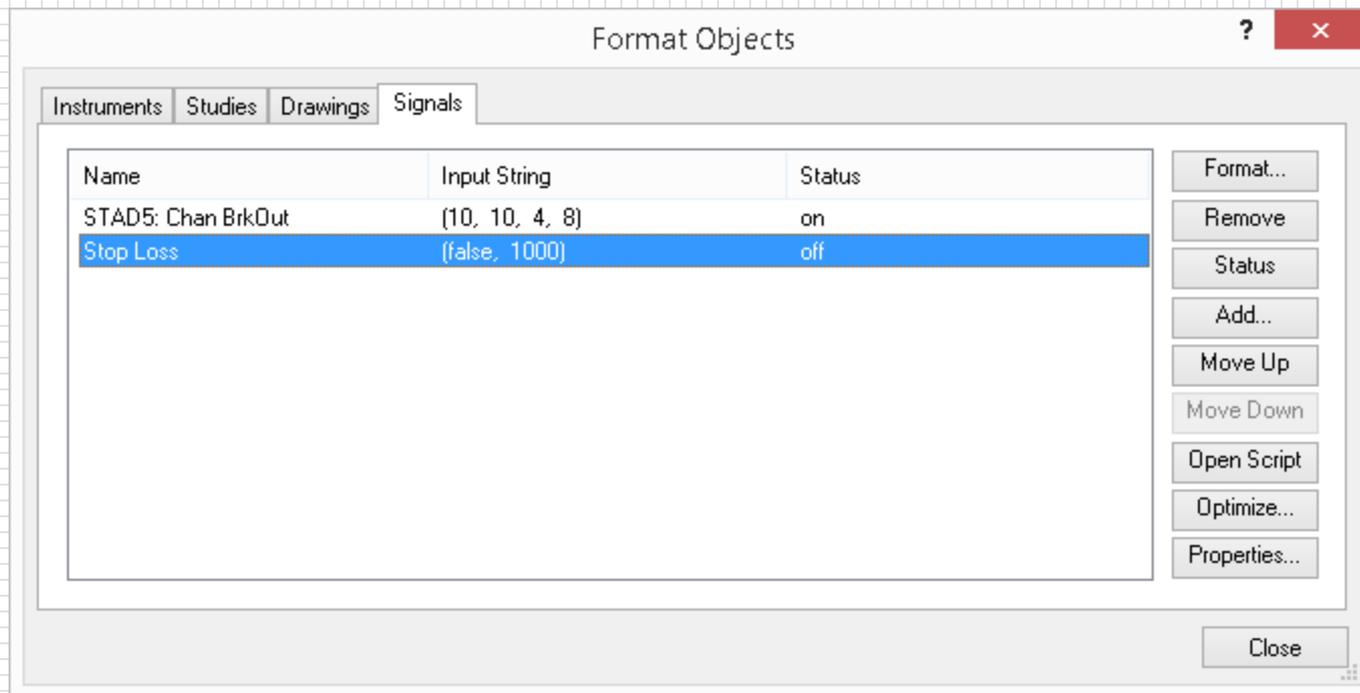
INSTALLIAMO LA TWS DI IB

Attenzione: prima di procedere verificate di avere Java installato nel pc

COMPOSIZIONE DI UNA STRATEGIA

All'interno di una chart window è possibile inserire più segnali (SIGNAL) ed ottenere una strategia **composta**. Vedremo più avanti i rischi connessi all'utilizzo di una strategia composta.

COMPOSIZIONE DI UNA STRATEGIA

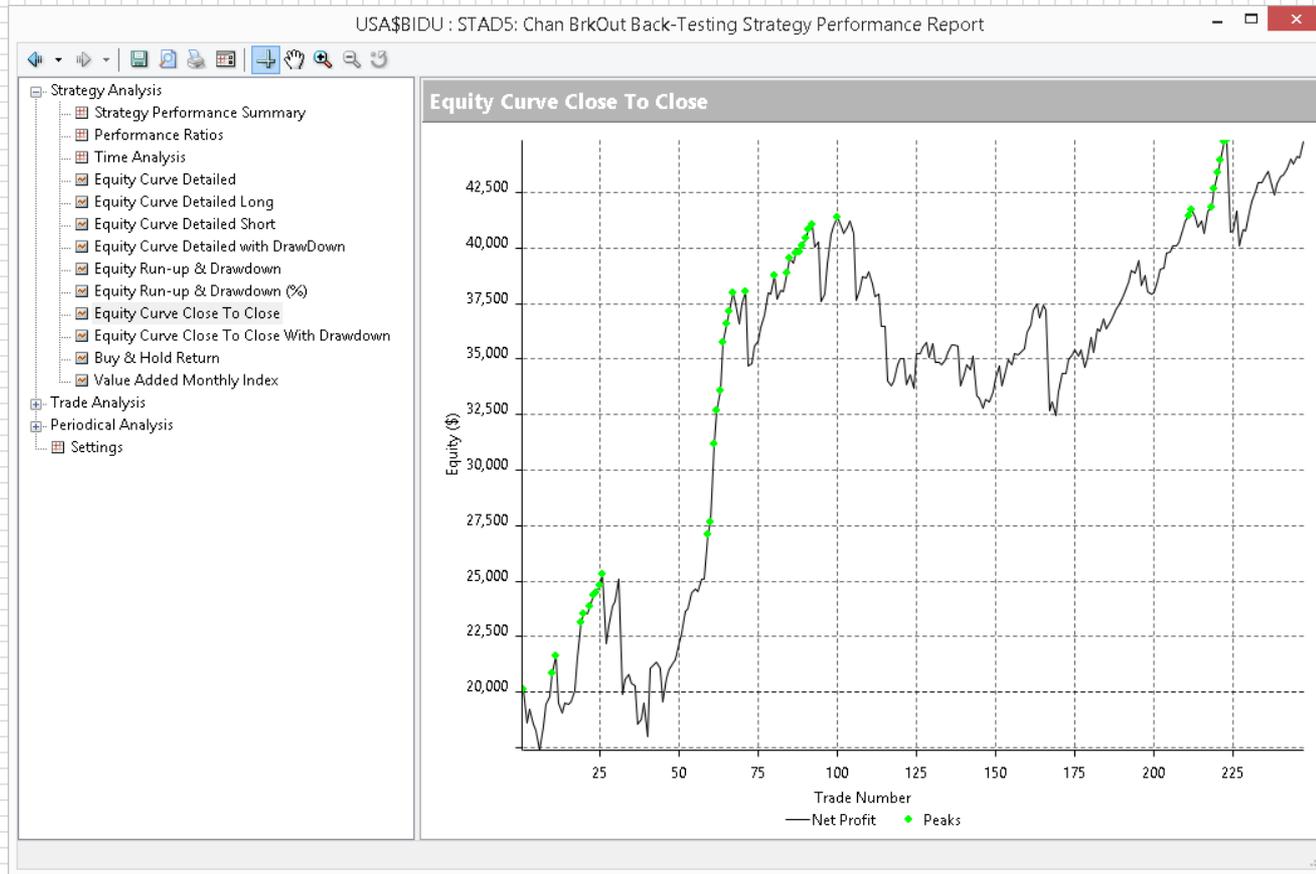


EQUITY LINE

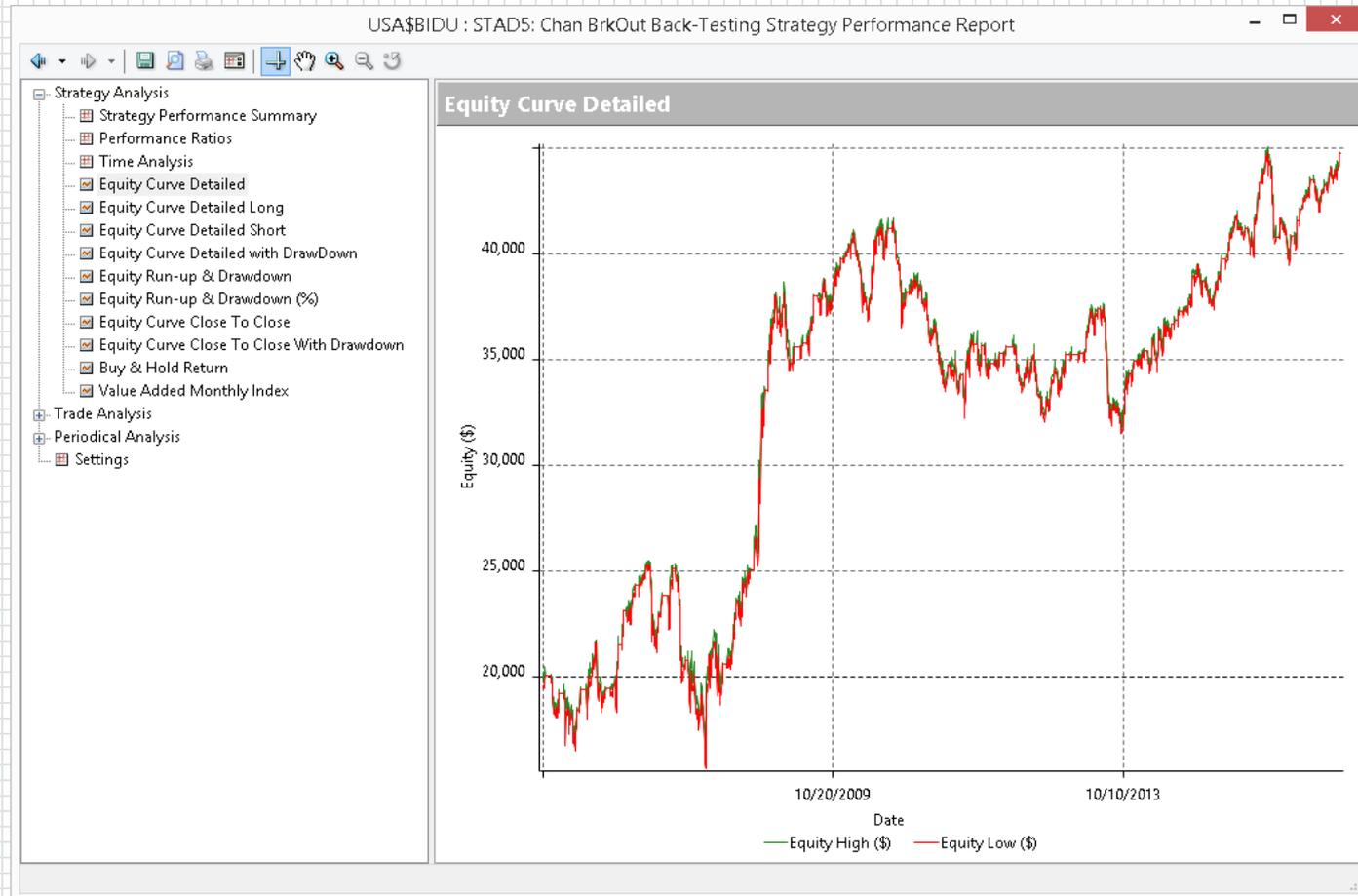
La curva cumulativa dei profitti rappresenta graficamente moltissime informazioni del performance report.

- La Equity line close-to-close mostra solo le operazioni concluse;
- La Equity line dettagliata mostra i movimenti intra-trade (escursioni) che ha avuto ogni singola operazione e di conseguenza il conto di trading.

EQUITY LINE CLOSE-TO-CLOSE



EQUITY LINE DETTAGLIATA



DA DOVE INIZIARE?

1. Drawdown (dimensione del rischio)
2. Rapporto Profitto netto / Drawdown
3. Numero di operazioni (significatività statistica)
4. Average trade (capienza singole operazioni)

PIÙ, È MEGLIO?

Fino ad un certo punto. Chiaramente più in profondità si riesce ad andare e più è significativo il test in quanto il numero di operazioni sarà ampio.

Attenzione ai risultati troppo lontani nel passato! Hanno un grado di significatività inferiore rispetto a quelli dell'ultimo periodo.

COSTI OPERATIVI

Tenere sempre in considerazione se il test è stato effettuato con o senza i costi operativi:

- Commissioni
- Slippage

SLIPPAGE

Vedremo più avanti che lo slippage è influenzato da più fattori:

1. Infrastruttura informatica;
2. Tipo di ordine;
3. Tipo di strategia;
4. Liquidità del mercato.

PERFORMANCE REPORT

Sembra una contraddizione, ma il performance report DEVE essere utilizzato per comprendere il COMPORTAMENTO del sistema e non la bontà del sistema.

La valutazione di un sistema di trading è un processo formato da più analisi, in cui è incluso il performance report, ma è solo uno degli anelli della catena.

MARKET SCANNER

Il market scanner ci aiuta a scorrere velocemente un elenco selezionato di strumenti finanziari per visionare le equity line di uno stesso trading system. Per deve essere utilizzato con questo fine deve essere collegato alla chart con lo stesso colore nel riquadro (i)

MARKET SCANNER

