

il Conte Caimano

Stefano Caroti Ghelli
master@infofinanza.com

Monitor Caimano

come gestire in autonomia il proprio patrimonio



Sommario

Avvertenza	3
Disclaimer	3
Considerazioni iniziali	4
Alla scoperta del Monitor Caimano	6
Foglio Quotazioni.....	7
Foglio Report.....	9
Foglio PTF attivo.....	11
Foglio Storico Operazioni:	12
Foglio TS Long Shares V3.0	14
Foglio Analisi PTF:	18
Suggerimenti operativi.....	20
Appendice	22
Filosofia Caimana.....	22
ProRealTime® – piattaforma di trading	23
Le Dispense dei Caimani della Finanza	24
TS Long Shares V3.0 - Investire in azioni senza pensieri	24
Prossime pubblicazioni.....	25
TS Ehlers Stochastic - L’indicatore Predittivo	25
TS DEMA Caimana	25
Materiale Didattico	26
Cenni sull’ autore	27

Avvertenza

Questa dispensa in formato PDF e tutti gli script contenenti codici di programmazione, da importare nella piattaforma [ProRealTime®](#), verranno inviati gratis via e-mail a chi li richiederà a master@infofinanza.com unendo una qualunque prova di acquisto della dispensa stessa.

Per essere aggiornati sulle prossime pubblicazioni potete inviare una richiesta via e-mail a master@infofinanza.com

Tutti i [Caimani della Finanza](#) in servizio attivo troveranno gli script all'interno dell'area riservata nel [Cloud](#), potranno scaricarli sul proprio computer e importarli nella piattaforma [ProRealTime®](#)

L'accesso al [Cloud](#) dei [Caimani della Finanza](#) è gratuito per tutti i partecipanti all'anno accademico e valido per un anno. All'interno vi è custodito un vero e proprio tesoro: tutti gli indicatori, i trading system, i metodi, gli algoritmi etc., sviluppati dai Caimani nel corso di anni, assolutamente introvabili altrove.

Disclaimer

Le opinioni espresse in questo testo non intendono in alcun modo costituire un invito a porre in essere qualsiasi transazione di strumenti finanziari. Non rappresentano perciò in alcun modo una sollecitazione del pubblico risparmio o consulenza all'investimento.

Le informazioni presenti nel testo sono da considerarsi solo una sintesi indicativa e informativa. Chi scrive può essere interessato all'acquisto di uno dei prodotti finanziari menzionati come investitore privato.

Eventualmente potremmo anche avere posizioni nei titoli menzionati. La presente non costituisce sollecitazione a comprare o vendere nulla.

Si rammenta che i mercati possono salire come scendere e che, a nostra conoscenza, non esiste tecnica perfetta per investire e fare trading. Pertanto, non è possibile assumerci responsabilità per perdite derivanti dalle indicazioni fornite.

L'attività di trading comporta rischi elevati di perdite economiche. L'investitore deve considerare attentamente i rischi inerenti all'attività di trading.

Considerazioni iniziali

Parafrasando la battuta finale di Al Pacino - *“La vanità è decisamente il mio peccato preferito.”* - nel film *L'avvocato del diavolo* per la maggior parte di noi *L'avidità è decisamente il peccato che preferiamo.*

Nel nostro intimo più profondo desideriamo arricchirci velocemente senza correre nessun rischio, è proprio su questa intima leva che capita spesso d'imbattersi nei sedicenti guru, che promettono mirabolanti risultati anche con capitali esigui.

Con soli 100 € in pochi giorni potrai smettere di lavorare e vivere di rendita; personaggi che raccontano di aver cambiato vita grazie a questo o quello (opzioni binarie, bitcoin, ... segnali esoterici e chi più ne ha ne metta).

L'enorme diffusione di internet ha poi fatto proliferare messaggi di questo tipo.

Che fare allora? provare ad affidarsi a tutto questo sperando di averlo trovato proprio noi quello “giusto”, quello “bravo”?

Oppure affidarsi ai consigli di un professionista bancario o simile?

Durante l'esperienza di anni maturata proprio in questo settore ho visto patrimoni investiti in gestioni patrimoniali, fondi comuni, Sicav, unit linked, index bond, e in mille altri prodotti ideati e pensati dall'industria del risparmio e regolarmente **venduti** dai vari professionisti bancari e/o assimilati.

Molti di noi avranno toccato con mano, e con il proprio portafoglio, proprio questa parte **comprando** prodotti finanziari di varia natura e aspettandoci risultati più che soddisfacenti.

Ma come spesso accade i risultati spesso non corrispondono alle aspettative, e da qui parte una serie infinita e ricorrente di motivazioni che tentano di giustificare il mancato guadagno se non addirittura la perdita in conto capitale.

Il tallone d'Achille della maggior parte degli approcci al mondo della gestione del risparmio è basato proprio sulla vendita di prodotti infiocchettati con una sorta di consulenza finanziaria, volta in buona parte dei casi non a risolvere esigenze, bensì a vendere uno o più prodotti.

Ovviamente non tutti i consulenti finanziari che operano sul mercato sono da annoverare in questa schiera, ma non è facile trovarne che non abbiano interessi, e quindi guadagni, nella vendita dei prodotti finanziari/assicurativi.

La consulenza finanziaria è un mestiere bellissimo, ma anche complesso, che necessita di studio continuo e di metodo.

Ed eccoci a noi, a questa dispensa che non vuole assolvere al compito di consulenza finanziaria, bensì ha lo scopo di fornire quelle regole, quel metodo necessario a ridurre gli errori e monitorare il proprio capitale faticosamente risparmiato/guadagnato.

Utilizzando il file Excel® Monitor Caimano sarà possibile, in completa autonomia, monitorare il proprio portafoglio d'investimenti in titoli, aggiustando le posizioni a seconda dei segnali che provengono da uno o più sistemi di analisi tecnica sviluppati con [ProRealTime®](#).

Viene creato un connubio tra lo studio dei possibili risultati in termini di guadagno potenziale e di massima perdita e la creazione e gestione di un portafoglio di titoli, misurato anche questo sulla propria propensione al rischio.

Il Monitor Caimano permette di calcolare quanti titoli detenere in portafoglio in base alla massima perdita che possiamo sopportare.

Una volta determinati quanti titoli possiamo passare a quali titoli acquistare e quanto tempo tenerli in portafoglio.

Quest'operazione viene demandata all'utilizzo di informazioni provenienti dai report dettagliati generata dall'utilizzo dell'applicativo ProBackTest (analisi sistemi di trading) della piattaforma di [ProRealTime®](#).

Diventerà agevole creare le proprie liste di titoli che possiamo selezionare con le più disparate modalità, dalla simpatia verso un titolo (non è molto scientifica, ma più comune di quanto pensiate), ad analisi su parametri di bilancio (analisi fondamentale per i più esperti) oppure basandosi su screener realizzati con l'applicativo ProScreener della piattaforma di [ProRealTime®](#).

Come dicevo nelle avvertenze non è necessario che siate esperti programmatori sia per gli screener che per i sistemi di trading di [ProRealTime®](#). Potete utilizzare script preconfezionati che devono solo essere importati nella piattaforma ed utilizzati.

In questa dispensa, per la parte di segnali operativi – cosa e quando comprare e/o vendere – utilizziamo due trading system (***TS Long Shares V3.0*** e TS DEMA Caimana), ma come detto potete utilizzarne altri creati da voi oppure reperiti altrove.

Monitor Caimano offre un metodo scientifico, che non ha la pretesa di essere il migliore, bensì ha lo scopo di determinare la procedura sistematica necessaria a gestire il proprio patrimonio, azzerando tutte quelle scelte dettate dall'emotività.

Alla scoperta del Monitor Caimano

Lo strumento di analisi e gestione Monitor caimano è basato su un file Excel® semi-automatico. Per semplificarne l'utilizzo anche ai meno esperti è stato creato con alcuni automatismi che permettono di facilitarne e velocizzarne l'utilizzo.

Nella figura 1.1. sono mostrati tutti i fogli che compongono il Monitor Caimano.

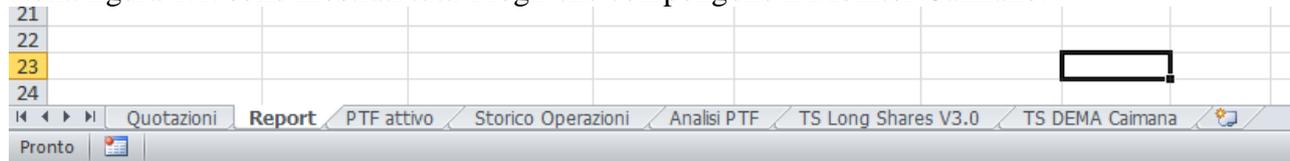


Figura 1.1

Prima di approfondirne nel dettaglio l'utilizzo è necessario riepilogare in breve lo scopo di ogni foglio.

Foglio Quotazioni:

contiene l'elenco dei titoli che comporranno il portafoglio che vogliamo monitorare e permette, con una procedura automatica, di estrarre dal sito di Yahoo Finance il valore dell'ultima chiusura, con la relativa data, di ogni titolo presente nell'elenco.

Foglio Report:

contiene le formule per calcolare il numero massimo di titoli da tenere in portafoglio. Riporta inoltre il risultato in termini economici della gestione dei titoli presenti in portafoglio.

Foglio PTF attivo:

contiene l'elenco dei titoli presenti in portafoglio, calcolandone il guadagno definito latente in quanto sono operazioni aperte e non ancora concluse.

Foglio Storico Operazioni:

simile al foglio PTF Attivo contiene l'elenco di tutte le operazioni aperte e chiuse. Le formule presenti nel foglio calcolano in automatico il guadagno complessivo che la nostra attività sta producendo.

Foglio Analisi PTF:

contiene l'elenco dei titoli che abbiamo selezionato e che comporranno il nostro portafoglio. Sono presenti formule che permettono di decidere se un titolo può essere inserito nel portafoglio oppure se è preferibile sostituirlo con un altro.

Foglio TS Long Shares V3.0:

Simile al foglio Analisi PTF contiene l'elenco di tutti i titoli che abbiamo analizzato con il trading system **TS Long Shares V3.0**. Fornisce la base dati di tutti i titoli di nostro interesse che ancora non hanno dato segnali d'acquisto.

Foglio TS DEMA Caimana:

Simile al foglio Analisi PTF e come per il foglio **TS Long Shares V3.0** contiene l'elenco di tutti i titoli che abbiamo analizzato con il trading system **TS Long Shares V3.0**. Fornisce la base dati di tutti i titoli di nostro interesse che ancora non hanno dato segnali d'acquisto.

Foglio Quotazioni

Abbiamo detto che questo è un foglio semi-automatico, al suo interno sono presenti delle macro che consentono di estrarre automaticamente dal sito Yahoo Finance i valori dell'ultima chiusura, la relativa data e la denominazione di ogni titolo elencato nella colonna A.

Symb	Titolo	Data	Prezzo
^IXIC	NASDAQ Composite (^IXIC)	25/04/2019	8.118,68
^GSPC	S&P 500 (^GSPC)	25/04/2019	2.926,17
^DJI	Dow Jones Industrial Average (^DJI)	25/04/2019	26.462,08

Figura 1.2

Il vostro unico compito è quello di scrivere dalla cella A5 in poi il simbolo dei titoli di vostro interesse.

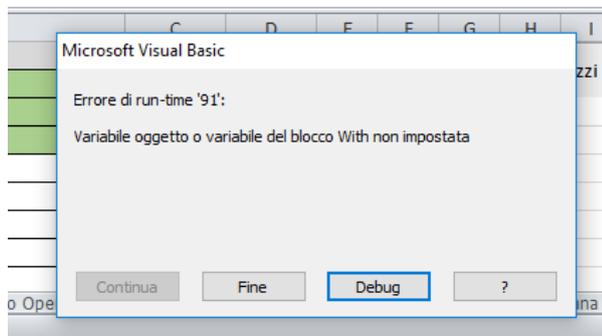
Symb	Titolo	Data	Prezzo
^IXIC	NASDAQ Composite (^IXIC)	25/04/2019	8.118,68
^GSPC	S&P 500 (^GSPC)	25/04/2019	2.926,17
^DJI	Dow Jones Industrial Average (^DJI)	25/04/2019	26.462,08
AAPL			
NTFLX			
BA			

Cliccando sul tasto Aggiorna Prezzi verranno estratti i dati sopra citati.

Ponete attenzione a come scrivete i simboli dei titoli poiché in caso di errori il sistema genererà un errore e non completerà l'estrazione delle informazioni.

Figura 1.3

Nell'esempio in figura 1.3 il simbolo del titolo Netflix è stato scritto in modo errato (NTFLX invece di NFLX) ed il sistema ha generato l'errore mostrato in figura 1.4



Per procedere basta cliccare sul tasto Fine, correggere il simbolo sbagliato e cliccare nuovamente sul tasto Aggiorna Prezzi.

Tenete presente che un errore simile potrebbe capitare anche quando la linea internet subisce forti rallentamenti.

Figura 1.4

Il termine della fase di estrazione dei dati comparirà una finestra che informerà che il processo è stato completato, per proseguire basta premere sul tasto OK e avremo nel nostro foglio Quotazioni tutti i dati che ci necessitano per calcolare il guadagno del nostro portafoglio.

The screenshot shows an Excel spreadsheet with the following data:

Symb	Titolo	Data	Prezzo
^IXIC	NASDAQ Composite (^IXIC)	25/04/2019	8.118,68
^GSPC	S&P 500 (^GSPC)	25/04/2019	2.926,17
^DJI	Dow Jones Industrial Average (^DJI)	25/04/2019	26.462,08
AAPL	Apple Inc. (AAPL)	25/04/2019	205,28
NFLX	Netflix, Inc. (NFLX)	25/04/2019	368,33
BA	The Boeing Company (BA)	25/04/2019	382,8

A dialog box titled "Microsoft Excel" with the text "Process Completed" and an "OK" button is overlaid on the spreadsheet. The spreadsheet also features a button labeled "Aggiorna Prezzi" in the top right corner.

Figura 1.5

Foglio Report

Questo foglio di calcolo è deputato al calcolo di quanti titoli dovrà contenere il nostro portafoglio in base alla nostra personale propensione al rischio, nonché al nostro capitale da investire.

Oltre a questo il foglio di calcolo riepiloga in automatico i risultati derivanti dalle varie operazioni che verranno eseguite sui singoli titoli.

Il foglio Report non ha la pretesa di effettuare sofisticati calcoli di matematica finanziaria, semmai ha il compito di rispondere alla domanda che tutti noi ci poniamo. Il mio conto corrente aumenta di valore oppure no?

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J
1	Capitale Iniziale	%Effetto Noè	Importo Max per titolo	Perdita Max Giornaliera	Importo per titolo	Quanti Titoli				
2										
3										
4										
5										
6		Data Inizio	Capitale Investito	Data Analisi	Controvalore PTF	Profitto Netto	Var%	% annua	% di Successo	
7	PTF attivo	25/04/2019	0,00	25/04/2019	0,00	+ 0,00	+ 0,00%	+ 0,00%		
8	Operazioni Chiuse	01/01/2019		25/04/2019		+ 0,00	+ 0,00%	+ 0,00%		
9	Saldo sul conto		0,00							
10	Report Complessivo	01/01/2019	0,00	25/04/2019	0,00	+ 0,00	+ 0,00%	+ 0,00%	#DIV/0!	
11										
12										
13										
14										
15										

Figura 2.1

Il Monitor Caimano come standard prevede che l'utente inserisca manualmente le informazioni richieste in corrispondenza delle celle di colore giallo. Questo vale per ogni singolo foglio di lavoro.

Capitale Iniziale:

in questa cella dovete inserire l'importo del capitale che volete investire

%Effetto Noè:

per Effetto Noè¹ s'intendono quelle variazioni selvagge che interrompono bruscamente la direzione dei mercati. In pratica è la massima perdita in percentuale che vogliamo arginare.

Perdita Max Giornaliera:

in questa cella dovete inserire l'importo massimo che siete disposti a perdere in caso si verifichi l'Effetto Noè.

Importo per titolo:

in questa cella potete inserire un importo minore rispetto a quello calcolato automaticamente ed evidenziato nella cella Importo Max per titolo. Così facendo potrete aumentare il numero di titoli da tenere in portafoglio, ma tenendo sempre sotto controllo la perdita massima che siete disposti a sopportare.

¹ Nel cloud de "I Caimani della Finanza" è presente una dettagliata dispensa sull' Effetto Noè

In figura 2.2 è mostrato un esempio di quanti titoli e di quale importo massimo possiamo utilizzare nel nostro portafoglio in base al capitale disponibile ed alla propensione al rischio di un Effetto Noè del 20%

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J
1	Capitale Iniziale	%Effetto Noè	Importo Max per titolo	Perdita Max Giornaliera	Importo per titolo	Quanti Titoli				
2	20.000,00	20,00%	5.000	1.000		4				
3										
4										
5										
6		Data Inizio	Capitale Investito	Data Analisi	Controvalore PTF	Profitto Netto	Var%	% annua		% di Successo
7	PTF attivo	25/04/2019	0,00	25/04/2019	0,00	+ 0,00	+ 0,00%	+ 0,00%		
8	Operazioni Chiuse	01/01/2019		25/04/2019		+ 0,00	+ 0,00%	+ 0,00%		
9	Saldo sul conto		20.000,00							
10	Report Complessivo	01/01/2019	20.000,00	25/04/2019	20.000,00	+ 0,00	+ 0,00%	+ 0,00%		#DIV/0!
11										
12										
13										
14										
15										

Figura 2.2

In figura 2.3 invece ho impostato l'importo per ogni titolo sia al massimo 2.000, così facendo invece di 4 titoli potrò inserirne 10 in portafoglio.

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J
1	Capitale Iniziale	%Effetto Noè	Importo Max per titolo	Perdita Max Giornaliera	Importo per titolo	Quanti Titoli				
2	20.000,00	20,00%	5.000	1.000	2.000	10				
3										
4										
5										
6		Data Inizio	Capitale Investito	Data Analisi	Controvalore PTF	Profitto Netto	Var%	% annua		% di Successo
7	PTF attivo	25/04/2019	0,00	25/04/2019	0,00	+ 0,00	+ 0,00%	+ 0,00%		
8	Operazioni Chiuse	01/01/2019		25/04/2019		+ 0,00	+ 0,00%	+ 0,00%		
9	Saldo sul conto		20.000,00							
10	Report Complessivo	01/01/2019	20.000,00	25/04/2019	20.000,00	+ 0,00	+ 0,00%	+ 0,00%		#DIV/0!
11										
12										
13										
14										
15										

Figura 2.3

L'azione che compie il foglio Report è quella di definire semplicemente le regole base della gestione del nostro capitale, detta anche Money Management.

I criteri utilizzati in questo foglio di calcolo si basano sulla formula di Kelly²

² La formula di Kelly è citata anche nel testo Come guadagnare in borsa con internet di Renato Di Lorenzo

Foglio PTF attivo

Questo foglio di calcolo è quello che si definisce un Paper Trading, rappresenta il diario di tutte le posizioni che abbiamo aperto sul mercato. È in parte automatico in quanto la denominazione del titolo, l'ultimo prezzo di chiusura e la relativa data sono estratti dal foglio di calcolo Quotazioni. Ovviamente sono presenti anche tutte le formule necessarie a calcolare il guadagno latente, la variazione percentuale e quella annua, nonché la percentuale di successi.

Titoli in PTF	Guadagno Latente					Data Inizio	Capitale Investito		Data Analisi		Controvalore PTF		Profitto	Var %		%Annua	% di Successo
0						01/01/2019	0,00		25/04/2019		0,00		0,00	+ 0,00%		+ 0,00%	
Symb	Titolo	Data IN	Advice	Lotti	Prezzo IN	Capitale Investito	Spese	Data	Prezzo oggi	Controvalore PTF	Spese	Profitto gain	Profitto var%	Giorni	%Annua	controllo successi	
			long			0,00				0,00		+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%		
			long			0,00				0,00		+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%		
			long			0,00				0,00		+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%		
			long			0,00				0,00		+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%		
			long			0,00				0,00		+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%		
			long			0,00				0,00		+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%		
			long			0,00				0,00		+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%		

Figura 3.1

Ogni volta che verrà acquistato e/o venduto un titolo si dovranno inserire le relative informazioni nelle apposite celle evidenziate in giallo.

Nel caso di primo acquisto dovremo inserire il simbolo del titolo, la data di apertura della posizione long (acquisto) il numero di azioni acquistate ed il prezzo che le abbiamo pagate. Si potrà inserire anche le spese di negoziazione sia per l'acquisto che per la futura vendita.

A titolo esemplificativo poniamo di aver acquistato il titolo Apple (AAPL) il 20/03/2019; abbiamo comprato 11 titoli ad un prezzo di 186.23 con spese di negoziazione pari a 2\$ per acquisto e altri 2 \$ per la futura vendita. Il risultato che otteniamo è mostrato in figura 3.2

Titoli in PTF	Guadagno Latente					Data Inizio	Capitale Investito		Data Analisi		Controvalore PTF		Profitto	Var %		%Annua	% di Successo
1						01/01/2019	2,048,53		25/04/2019		2,258,08		205,55	+ 10,03%		+ 32,13%	100,00%
Symb	Titolo	Data IN	Advice	Lotti	Prezzo IN	Capitale Investito	Spese	Data	Prezzo oggi	Controvalore PTF	Spese	Profitto gain	Profitto var%	Giorni	%Annua	controllo successi	
AAPL	Apple Inc. (AAPL)	20/03/2019	long	11	186,23	2,048,53	2	25/04/2019	205,28	2,258,08	2	+ 205,55	+ 10,03%	36	+ 101,73%	1	
			long			0,00				0,00		+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%		
			long			0,00				0,00		+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%		
			long			0,00				0,00		+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%		
			long			0,00				0,00		+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%		
			long			0,00				0,00		+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%		
			long			0,00				0,00		+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%		

Figura 3.2

Come abbiamo detto il foglio di calcolo riporta automaticamente la data dell'ultima rilevazione e l'ultimo prezzo di chiusura del titolo, estraendoli dal foglio Quotazioni, quindi potremo aggiornare tutto il portafoglio cliccando sul tasto Aggiorna Prezzi nel foglio Quotazioni.

Per ogni titolo presente nel portafoglio viene calcolato il profitto, la variazione percentuale dall'acquisto, la proiezione annua di tale percentuale e l'indicazione se l'operazione è positiva oppure negativa, necessaria per il calcolo della percentuale di successo.

Il foglio di calcolo riporta le stesse informazioni calcolandole sull'intero paniere di titoli presenti in portafoglio.

Inoltre vengono conteggiati quanti titoli sono presenti nel portafoglio (in alto a sinistra) in modo da evitare di acquistarne più di quelli preventivati e calcolati nel foglio Report.

Foglio Storico Operazioni:

Questo foglio di calcolo è simile al foglio PTF attivo in quanto raccoglie le stesse informazioni fissandole alla data ed al prezzo di vendita del titolo che avevamo in portafoglio.

Esegue tutti gli stessi calcoli del foglio PTF attivo in modo da tener traccia del profitto che varia ad ogni operazione conclusa (acquisto e vendita).

L'azione da compiere è quella di digitare nella cella Data OUT la data di vendita del titolo e nella cella Prezzo OUT il prezzo di vendita.

Figura 4.1

Le informazioni da inserire in questo foglio possono essere copiate ed incollate dal foglio PTF attivo. In pratica una volta che viene venduto un titolo presente in portafoglio potete selezionare tutta la riga relativa al titolo come mostrato in figura 4.2.

Figura 4.2

Copiarla digitando contemporaneamente i tasti Ctrl+C dopodiché incollarla nel foglio Storico Operazioni digitando contemporaneamente Ctrl+V.

Una volta eseguito questo passaggio dovrete aggiornare i valori nelle relative celle Data OUT e Prezzo Out con i dati della vendita del titolo.

1	Monitor IN PTF	Storico operazioni chiuse							Data Inizio	Capitale Investito	Data Analisi	Controvalore PTF	Profitto	Var %	%Annuale	% di Successo
2	1								01/01/2019	2.048,53	25/04/2019	2.258,08	+ 205,55	10,03%	+ 32,13%	100,00%
3	Symb	Titolo	Data IN	Advice	Lotti	Prezzo IN	Capitale Investito	Spese	Data OUT	Prezzo OUT	Controvalore PTF	Spese	Profitto gain	var%	Giorni	%Annuale controllo successi
5	AAPL	Apple Inc. (AAPL)	20/03/2019	long	11	186,23	2.048,53	2	25/04/2019	205,28	2.258,08	2	+ 205,55	+ 10,03%	36	+ 101,73% 1
6				long			0,00	2				2	+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%
7				long			0,00	2				2	+ 0,00	+ 0,00%		+ 0,00%

Figura 4.3

Fatto questo ulteriore passaggio dovrete eliminare la riga selezionata nel foglio PTF attivo, in modo da tenere aggiornato il portafoglio dei titoli ed il relativo guadagno latente.

Quello fin qui esposto è propedeutico al controllo del ritorno economico del nostro capitale investito, ma il vero cuore del Monitor Caimano è racchiuso nel foglio di calcolo Analisi PTF, il quale si basa sulle informazioni riportate nei fogli di calcolo **TS Long Shares V3.0** e TS DEMA Caimana.

È questa caratteristica che permette ad ognuno di personalizzare il Monitor Caimano con le più disparate strategie utilizzate con i trading system di **ProRealTime®**.

Per questa dispensa ho utilizzato due miei trading system il **TS Long Shares V3.0**³ e il TS DEMA Caimana. Ovviamente è possibile utilizzarne anche solo uno di questi oppure altri anche in aggiunta. Suggesto comunque, nel caso si utilizzino più sistemi, di scegliere sistemi di trading che abbiano strategie diverse le une dalle altre in modo da apportare ulteriori riduzioni di rischio al portafoglio.

Prima di passare al funzionamento del foglio PTF analisi è doveroso analizzare il funzionamento dei fogli **TS Long Shares V3.0** e TS DEMA Caimana.

In effetti basta analizzare il funzionamento di uno solo dei due fogli in quanto quello che cambia sono solo i dati e le informazioni che è necessario inserire nei fogli di calcolo.

³ Su Amazon è disponibile la prima versione del TS Long Shares <https://amzn.to/2GNv7gV>

Foglio TS Long Shares V3.0

Questo foglio di calcolo nasce dall'esigenza di poter scegliere se comprare un titolo oppure un altro utilizzando un metodo il più possibile scientifico.

Non avendo a disposizione capitali infiniti ogni investitore può trovarsi davanti alla possibilità di acquistare più titoli, ma di non avere il capitale necessario a farlo. Quale scegliere tra tutti i papabili? Il bello, ma difficile, dei mercati finanziari è che non esistono regole segrete, informazioni che solo pochi hanno, che consentono di fare scelte sicure.

Non resta quindi che crearsi un proprio schema decisionale ed applicarlo in modo sistematico alla nostra gestione di portafoglio.

Dal momento che nessuno di noi prevede il futuro ho creato varie strategie che mi consentono di calcolare la percentuale di guadagno, la percentuale di successi, il rapporto tra guadagni e perdite e il la massima perdita su qualsiasi titolo desti il mio interesse.

Per ottenere questo dobbiamo utilizzare la piattaforma di [ProRealTime®](#), con la quale utilizzare trading system opportunamente programmati. Anche chi non è pratico di programmazione può utilizzare il Monitor Caimano, deve solo dotarsi di uno o più trading system di proprio gradimento, importarli nella piattaforma e testarli sui titoli che ritiene interessanti.

Ed eccoci alla prima questione, come scelgo i titoli su cui testerò il trading system?

Nuovamente non esiste l'unica tecnica, possono essere utilizzate le fonti più disparate personalmente utilizzo i seguenti criteri.

Come partecipante ai workshop de I [Caimani della Finanza](#) ricevo periodicamente le news letter del nostro Renato Di Lorenzo nelle quali sono individuati titoli in base a vari criteri di analisi fondamentale. Avendo cadenza settimanale è facile intuire che la quantità totale dei titoli individuati sia maggior di quella che possiamo acquistare mantenendo fede al calcolo dei titoli da detenere nel proprio portafoglio.

Oltre a questo tipo di selezione dei titoli utilizzo anche alcuni screener creati per [ProRealTime®](#) basati sulla strategia del trading system [TS Long Shares V3.0](#) e TS DEMA Caimana. Ovviamente potrebbero essere anche altri screener basati su strategie completamente diverse.

I titoli che screener e newsletter individuano li memorizzo in apposite liste di [ProRealTime®](#) in modo da rendere veloce la fase di analisi dei risultati del trading system che scelgo di utilizzare per decidere quando aprire la posizione su uno o più titoli.

Una volta create le liste di titoli interessanti è necessario eseguire il trading system su ogni titolo e raccogliere i dati presenti nel report dettagliato che genera la piattaforma [ProRealTime®](#).

Utilizziamo la strategia **TS Long Shares V3.0**, suggerisco trading system che non devono essere ottimizzati in quanto ad ogni ottimizzazione eseguita potrebbero corrispondere dati diversi e questo non permette di creare un metodo standard di scelta.

L'unica cosa da definire nel trading system è il periodo di analisi, il periodo nel quale verranno effettuati tutti i calcoli per ogni segnale di apertura e chiusura di posizione. Anche in questo caso non esiste un criterio unico, personalmente prediligo testare una strategia nell'arco di 5 anni, operando con time frame giornalieri.



In un periodo di 5 anni è probabile che si succedano fasi positive, negative ed anche laterali e questo mi permette di avere informazioni più precise sui risultati della strategia utilizzata.

In figura 5.1 è rappresentato il report dettagliato relativo al trading system **TS Long Shares V3.0** testato sul titolo AAPL.

Figura 5.1

In questo report sono presenti tutte quelle informazioni che dovremo inserire nel foglio di calcolo del Monitor Caimano.

Digitando nelle apposite celle i valori del report dettagliato otterremo il risultato mostrato in figura 5.2

Trading System	in PTF	Titolo	Inizio Periodo Analisi	Gain%	%successi	gain/loss	max Drawdown	Tempo a Mercato	Punteggio
Long Shares V3.0	-	AAPL	02/01/2014	61.37%	62.50%	2.27	855.89	47.02%	3.00
Long Shares V3.0	-								0.00
Long Shares V3.0	-								0.00
Long Shares V3.0	-								0.00
Long Shares V3.0	-								0.00
Long Shares V3.0	-								0.00
Long Shares V3.0	-								0.00
Long Shares V3.0	-								0.00
Long Shares V3.0	-								0.00
Long Shares V3.0	-								0.00
Long Shares V3.0	-								0.00
Long Shares V3.0	-								0.00
Long Shares V3.0	-								0.00

Figura 5.2

Cella nel foglio di calcolo	Informazione dal Report Dettagliato
<p>Inizio Periodo Analisi Digitare nella cella solo se la data Inizio è successiva a quella definita nella cella D3</p>	<p>Inizio: 2-gen-2014 [\$2.000,00] Fine: 31-dic-2018 [\$3.227,45]</p> <p>chiuse</p>
<p>Gain%</p>	<p>Statistiche delle posizioni chiuse</p> <p>Guadagno: \$1.227,45 (+61,37%)</p>
<p>%successi</p>	<p>% Trade vincenti</p> <p>62,5%</p>
<p>gain/loss</p>	<p>Guadagni / Perdite</p> <p>2,27</p>
<p>max Drawdown</p>	<p>Max drawdown: \$855,89 Max trade perdenti consecutivi: 6</p>
<p>Tempo a mercato</p>	<p>Tempo nel mercato</p> <p>47,02%</p>

Al fine di creare un criterio di scelta il foglio di calcolo del Monitor Caimano determina un punteggio per ognuno dei dati indicati nel report dettagliato. Questa operazione viene eseguita per ogni titolo presente nel foglio di calcolo, titoli che come detto precedentemente fanno parte di liste di **ProRealTime®** precompilate in base a criteri di analisi fundamenta, e/o analisi tecnica.

Trading System	in PTF	Titolo	Inizio Periodo Analisi	Gain%	%successi	gain/loss	max Drawdown	Tempo a Mercato	Punteggio	Gain%	%successi	calcolo punteggi parziali	gain/loss su tempo a mercato	GG analisi	< tempo a mercato	Punteggio per < tempo
Long Shares V3.0	-	AAPL	02/01/2014	61,37%	62,50%	2,27	855,89	47,02%	1,00	0,00	0,00	0,00	1,20	1,00		0,00
Long Shares V3.0	-	NFLX	31/12/2018	114,01%	72,41%	2,51	1.097,73	53,57%	2,97	1,00	1,00	1,00	1,17	0,97	1,824	0,00
Long Shares V3.0	-								0,00	0,00	0,00	0,00	0,00			0,00
Long Shares V3.0	-								0,00	0,00	0,00	0,00	0,00			0,00
Long Shares V3.0	-								0,00	0,00	0,00	0,00	0,00			0,00

Figura 5.3

Man mano che verranno inseriti dati per ogni titolo il punteggio subirà delle modifiche in quanto il foglio di calcolo applica una normalizzazione dei dati in base all’elenco dei titoli analizzati.

In sostanza il punteggio che andiamo a calcolare per ogni titolo dipende anche dal numero di titoli presenti nella lista e dai risultati del trading system su ognuno di questi titoli.

Il processo che viene applicato è quello di pesare ogni informazione generando così un valore unico, frutto della somma di tutti i punteggi parziali. Il punteggio finale ci permetterà poi di poter scegliere quali titoli acquistare in caso di capitale insufficiente ad acquistarli tutti.

Nelle celle Trading System e Titolo vanno riportati rispettivamente il nome della strategia utilizzata ed il simbolo del titolo su cui è stata effettuata l’analisi. Sono informazioni utili da conoscere nel caso si utilizzino più trading system.

Nella cella in PTF compare il simbolo “-” se il titolo analizzato non è presente nel portafoglio, mentre se il titolo è stato acquistato e si trova nel foglio PTF attivo compare il simbolo Si. Questa è una semplice accortezza che facilita nella selezione dei titoli da acquistare.

Si aprirà la finestra di dialogo con la quale impostare i criteri di ordinamento, come mostrato in figura 5.6

Trading System	in PTF	Titolo	Inizio Periodo Analisi	Gain%	Report %successi	Dettagliato gain/loss	ProRealTime max Drawdown	Tempo a Mercato	Punteggio	Gain%	%successi	calcolo gain/loss	punteggi parziali max Drawdown	gain/loss su tempo a mercato	GG analisi	< tempo a mercato	Punteggio per < tempo
Long Shares V3.0	-	AAPL		61.37%	62.50%	2.27	855.89	47.02%	1.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1.20	1.00		0.00
Long Shares V3.0	-	NFLX		114.07%	72.41%	2.51	1.097.73	53.57%	2.97	1.00	1.00	1.00	1.00	1.17	0.97		0.00

Figura 5.6

Basterà selezionare dal menu a tendina Ordina per selezionando la colonna J (relativa al punteggio) ed impostando, sempre dal menu a tendina, Ordine Dal più grande al più piccolo.

Otterremo il risultato voluto, tutti i titoli verranno ordinati in base al punteggio dal valore più alto a quello più basso.

Trading System	in PTF	Titolo	Inizio Periodo Analisi	Gain%	Report %successi	Dettagliato gain/loss	ProRealTime max Drawdown	Tempo a Mercato	Punteggio	Gain%	%successi	calcolo gain/loss	punteggi parziali max Drawdown	gain/loss su tempo a mercato	GG analisi	< tempo a mercato	Punteggio per < tempo
Long Shares V3.0	-	NFLX		114.07%	72.41%	2.51	1.097.73	53.57%	2.97	1.00	1.00	1.00	1.00	1.17	0.97		0.00
Long Shares V3.0	-	AAPL		61.37%	62.50%	2.27	855.89	47.02%	1.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1.20	1.00		0.00

Figura 5.7

Il più è fatto, non resta che monitorare il mercato con l'ausilio degli screener di [ProRealTime®](#) ed agire non appena un segnale d'acquisto, o di vendita, si verifica su uno dei titoli elencati nel foglio Analisi PTF.

Suggerimenti operativi

Fermo restando che ognuno può trovare il proprio metodo di utilizzo del Monitor Caimano può essere d'aiuto organizzare [ProRealTime®](#) in modo da setacciare agevolmente il mercato in cerca dei segnali d'acquisto e/o di vendita. Semplificando ulteriormente la gestione del proprio portafoglio.

La versione gratuita di [ProRealTime®](#) permette di creare liste contenenti i titoli di nostro interesse scelti da uno o più mercati. La limitazione di questa versione è data dal fatto che gli screener non funzionano in presenza di liste con titoli di mercati diversi.

Codice	Codice	Nome	Ultimo	%Var
AAPL		APPLE INC.	205,28(c)	-0,91%
AMZN		AMAZON.C...	1.902,25...	+0,03%
BEAT		BIOTELEME...	59,23(c)	+0,85%
BLMT		BSB BANC...	33,11(c)	+1,41%
BPOP		POPULAR I...	56,74(c)	+0,05%
CSIQ		CANADIAN ...	20,06(c)	-0,59%
FB		FACEBOOK...	193,26(c)	+5,85%
FIVE		FIVE BELO...	145,50(c)	-0,38%

Il primo suggerimento è quello di creare una lista di titoli per ogni mercato (Nasdaq, Nyse e così via) in modo da rendere veloce la ricerca dei titoli da negoziare.

Una volta create le liste la piattaforma ci consentirà di setacciare ogni lista scegliendola dall'elenco delle liste personalizzate.

Gestione ProScreener

Lista ProScreener

Nuovo Modifica Duplica Cancella Importa Esporta Aggiungere Aiuto

Filtro ProScreeners...

Selezione periodo: Giornaliero

Lista da scansire: Predefinita Personalizzata

- Lista WorkShop
- Long Shares NASDAQ
- Long Shares NYSE
- PTF test

Descrizione

```
// ----- Long Shares Finder
// basato sull'analogo trading system TS Long Shares V3.0
// -----

Individua nel mercato selezionato tutti i titoli che hanno generato un segnale di apertura della posizione rialzista.
```

Esegui ProScreener

Un altro suggerimento riguarda il monitoraggio dei titoli che abbiamo in portafoglio, anche in questo caso è utile creare un'apposita lista per ogni trading system che abbiamo utilizzato nel Monitor Caimano.

Oltre a creare la lista di titoli è bene creare anche il piano di lavoro con gli indicatori che rappresentano la strategia utilizzata nel trading system che abbiamo scelto.

Nel caso analizzato in questa dispensa il trading system **TS Long Shares V3.0** è composta, oltre che da screener di mercato ([Long Shares Finder](#), [Long Shares Continuing](#) e [Long Shares Trend](#)), da due indicatori, il [Long Shares Layout V3.0](#) ed il [Long Shares Index V3.0](#).

Il piano di lavoro che può essere creato è quello mostrato in figura 6.1.



Figura 6.1

Con un piano di lavoro così impostato sarà agevole controllare tutti i titoli presenti nel nostro portafoglio adeguando lo stop loss da Effetto Noè (indicato nel grafico dalla linea a punti nera), oppure chiudendo la posizione al segnale Chiusi Long nonché ridurre la posizione una volta arrivati al primo target profit.

Appendice

Filosofia Caimana

Il gruppo dei “[Caimani della Finanza](#)” nasce oltre dieci anni fa per iniziativa di Renato Di Lorenzo. Si trattava, all’inizio, di un gruppo di persone, in qualche modo interessate alla borsa, magari senza avere un’idea ben precisa di dove andare e magari alla ricerca di qualche formula magica per la ricchezza. Anche il nome di “Caimani”, ora consolidato, nacque un po’ per scherzo ma già allora indicava la continua ricerca di opportunità sul mercato finanziario.

Nel tempo, grazie a Renato e al gruppo storico, la situazione è radicalmente cambiata e oggi si tratta di una vera e propria comunità, o network relazionale per dirla con un termine abusato ma moderno, nel quale ciascuno si sente in dovere di portare le proprie idee e competenze ed è stimolato a produrre idee nuove o a sviluppare quelle degli amici che partecipano ai nostri incontri.

Crediamo che questo sia il reale valore aggiunto per chi partecipa a questa sorta di “Rotary” degli investimenti: nessuno di noi ha la pretesa di insegnare qualcosa ma tutti hanno l’esigenza di portare il loro contributo. Possiamo definirci come un gruppo di ricerca nel quale sono esplorati le varie tecniche e gli strumenti finanziari: se qualcuno ha un’idea, ci sarà sempre qualche altro amico che lo aiuterà a svilupparla perché le competenze del gruppo sono le più differenti anche per la diversa provenienza professionale.

Partecipare al gruppo non significa quindi iscriversi a un corso, anche se i neofiti avranno quest’approccio, ma la maggior parte di essi si ritroverà presto a produrre e presentare materiale da discutere con gli altri. Non si tratta quindi di “vendere qualcosa” ma di offrire un’opportunità di crescita consapevole in un campo, quello del trading e degli investimenti, dove la “fuffa”, ma anche la “truffa”, è sempre in agguato. Il render chiaro a tutti che la ricchezza non è dietro l’angolo è un risultato che avrebbe evitato a molti le varie catastrofi finanziarie nel quale gli italiani si sono imbattuti negli ultimi anni.

Non si può dimenticare la recente creazione della collana editoriale “I [Caimani della Finanza](#)”, per i tipi della LWRS, nella quale i più esperti si sono cimentati con l’attività di pubblicazione dei propri studi, ma tutti sono invitati a provare a produrre materiale pubblicabile.

Un ultimo aspetto, ma non per questo meno importante, è quello sociale: si va dagli incontri a solo scopo eno-gastronomico, soprattutto per quelli residenti nella stessa zona, alla partecipazione a qualche fiera del settore con la convinzione che anche questo serve alla crescita finanziaria di ciascuno.

Veniamo ai risultati: sicuramente tutti hanno la consapevolezza di cosa stanno facendo e del rischio che si corre. Molti chiudono l’anno col conto in attivo e molti si sono liberati di dannose consulenze finanziarie. Chi si aspetta qualche ricetta magica o la pappa pronta sicuramente non la troverà: potrà però osservare gli estratti conto di chi ha provato a sviluppare tecniche con noi.

ProRealTime® – piattaforma di trading

Il materiale didattico di questa dispensa è stato sviluppato e realizzato per essere utilizzato tramite la piattaforma di trading [ProRealTime®](https://www.prorealtime.com/it/).

Abbiamo scelto la piattaforma di [ProRealTime®](https://www.prorealtime.com/it/) (https://www.prorealtime.com/it/) in quanto risulta essere relativamente semplice ed intuitiva e, quindi, consente ai nuovi utenti di utilizzarla senza bisogno di una formazione specializzata.

La versione base di [ProRealTime®](https://www.prorealtime.com/it/) è gratuita con i dati a fine giornata e il sito della società è dotato di vari manuali utenti e arricchito da video di formazione sull'utilizzo delle principali caratteristiche della piattaforma stessa.

La piattaforma permette di creare semplicemente piani di lavoro personalizzati, salvandoli e richiamandoli secondo le proprie necessità. Per piano di lavoro s'intende la rappresentazione grafica di un determinato strumento finanziario corredata dagli indicatori di analisi tecnica che vogliamo utilizzare per analizzare l'andamento del titolo stesso.

Questa piattaforma offre un'ampia base d'indicatori di analisi tecnica e inoltre è possibile crearne di propri mediante l'applicazione denominata ProBuilder.

Un'altra applicazione molto utile è data dal ProBackTest/ProOrder con la quale è possibile realizzare sistemi di trading personalizzati e di poter testare la validità delle nostre strategie utilizzando tutto lo storico dei dati che abbiamo a disposizione.

La piattaforma ha inoltre l'applicazione ProScreener che consente di creare dei programmi per scandagliare il mercato alla ricerca dei titoli che rispettano determinate regole; anche quest'applicazione permette la creazione di screener personalizzati.

Per utilizzare al meglio le informazioni di questa dispensa si raccomanda lo studio dei manuali d'uso della piattaforma. Nella sezione Aiuto & Supporto troverete tre manuali utili alla comprensione dell'uso della piattaforma (Manuale Software) e nella programmazione dei codici per “Funzioni base & indicatori” (ProBuilder) e “Sistemi di trading” (ProBackTest & ProOrder).

Le Dispense dei Caimani della Finanza

TS Long Shares V3.0 - Investire in azioni senza pensieri

Nuova versione ulteriormente migliorata nella gestione della posizione per ridurre le perdite ed incrementare i guadagni.



La strategia del trading system TS Long Shares si raccomanda per la semplicità applicativa, per chi intende operare su titoli azionari.

Il sistema segnala quando aprire una posizione rialzista e con quanti titoli farlo; è pensato per un'operatività giornaliera in modo che chiunque possa seguirne i segnali dedicando una parte di tempo estremamente limitata e a mercati chiusi.

La strategia permette di gestire la massima perdita in modo da adeguarne il funzionamento in base alle proprie propensioni e al proprio capitale disponibile.

La dispensa è reperibile anche su

<https://www.amazon.it/TS-Long-Shares-V3-0-Investire-ebook/dp/B08HQTQYGP>

Prossime pubblicazioni

TS Ehlers Stochastic - L'indicatore Predittivo



Un nuovo modo di utilizzare fondamenti di elettronica per realizzare segnali operativi sugli indici di borsa.

Il sistema individua in anticipo le inversioni di tendenza del mercato, operando con un time frame giornaliero, adatto anche a chi non vuol passare tutto il giorno davanti ad uno schermo.

I segnali vengono generati a chiusura del mercato e sono validi per il giorno successivo. È possibile operare sia manualmente che in modalità automatica.

TS DEMA Caimana



La strategia del sistema TS DEMA Caimana è pensata per migliorare la tecnica del cassetista. Fornisce segnali di acquisto e/o di vendita a fine giornata.

Ottimizza il tempo di permanenza sul mercato gestendo anche la posizione aperta in modo da ridurre sensibilmente il drawdown complessivo su ogni singolo titolo su cui investiamo.

Materiale Didattico

Di Lorenzo Renato e Cuomo Emilio – I Segreti del Trading con Corinnah Kroft

<http://amzn.to/2hschjt>

Di Lorenzo Renato - Manuale di analisi tecnica. La guida completa, dai trend ai trading system

<https://amzn.to/2WHnqfz>

Di Lorenzo Renato - Fast Trading Series volume 3: Programmare ProRealTime

<https://amzn.to/2WFntc4>

Di Lorenzo Renato - Nuove (importanti) funzioni di ProRealTime: A fast & day trading protocol

<https://amzn.to/2WOSRFa>

Boroni Simone - Stop loss. Conservare i profitti guadagnati con il trading

<https://amzn.to/2WJ1jW9>

Andrew Hallam – Diventare Milionario con uno stipendio normale

<https://amzn.to/2OQEJH3>

Di Lorenzo Renato – Analytc Trading

<https://analytictrading.blogspot.com/>

ProRealTime® - piattaforma di trading

<https://www.prorealtime.com/it/>

Cenni sull’ autore



Sono un professionista del settore finanziario, opero con il preciso obiettivo di prestare consulenze indipendenti nel campo del risparmio, degli investimenti e del reperimento di risorse finanziarie.

Ho sviluppato esperienze nel settore dell’informatica operando inizialmente in società di ricerca e sviluppo per poi dedicarmi alla gestione della clientela pre e post-vendita di prodotti personalizzati.

La passione per la finanza mi ha portato dal 1996 a dedicarmi al settore della consulenza attraversando varie fasi, dalla promozione finanziaria con grandi gruppi nazionali e internazionali fino a quella attuale di consulente per imprese e privati.

Da oltre un decennio partecipo, anche come relatore e formatore, ai seminari de I [Caimani della Finanza](#), un gruppo di appassionati di finanza diventato nel tempo un vero e proprio network relazionale nel quale sono analizzate e perfezionate idee nel settore della gestione finanziaria personale.