



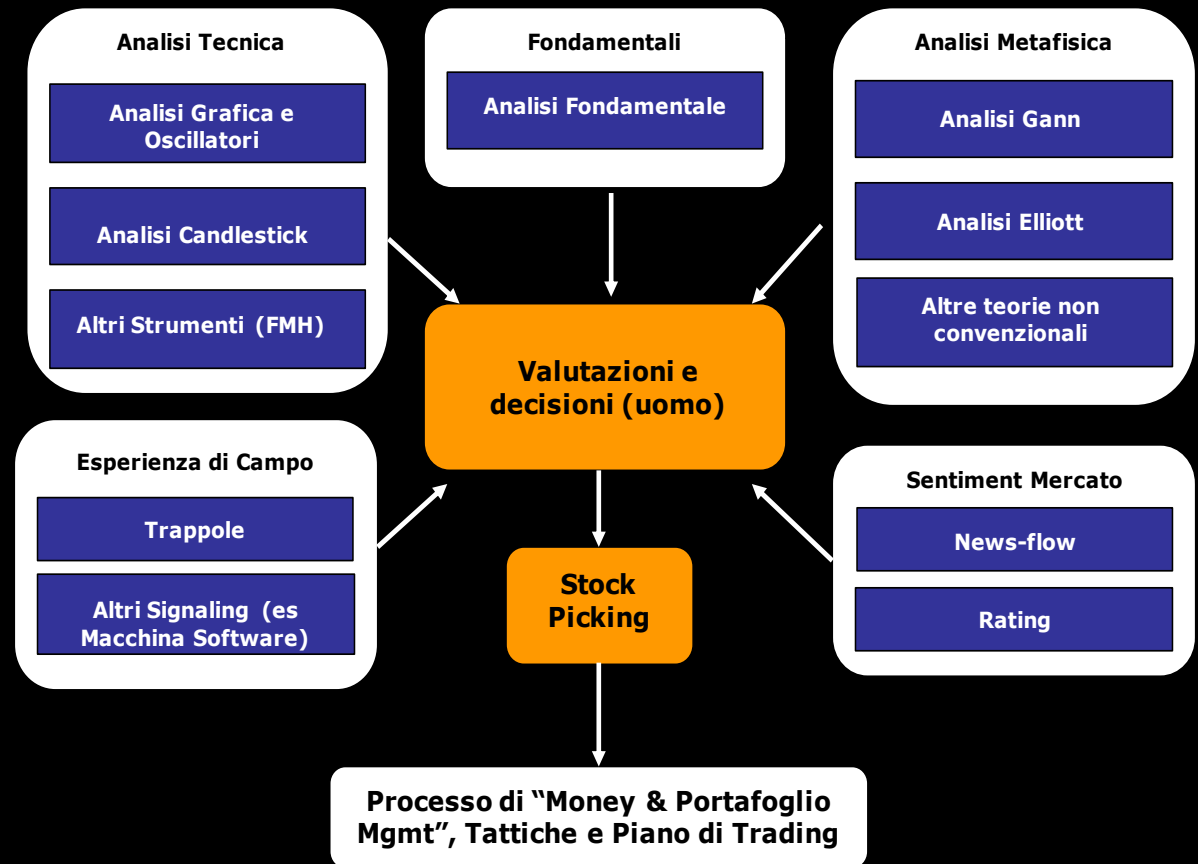
Trading System
FLOW-MID

Fabio Longo With Mirco D.

Il Trading System Ideale

Il TS ideale, secondo mia concezione, é l'insieme di una metodologia, di teorie, di strumenti analitici e delle capacità decisionali umane che permettono di eseguire una selezione su un prodotto finanziario per una operazione di acquisto o vendita.

Questa selezione dovrà successivamente essere collocata in un processo che prevede l'applicazione di specifiche tattiche operative, spostata con la strategia di portafoglio e producendo quindi un piano di trading sul prodotto finanziario. E' importante osservare che un signaling proveniente da un metodo specifico non è un trading system, ma semplicemente un input del trading system

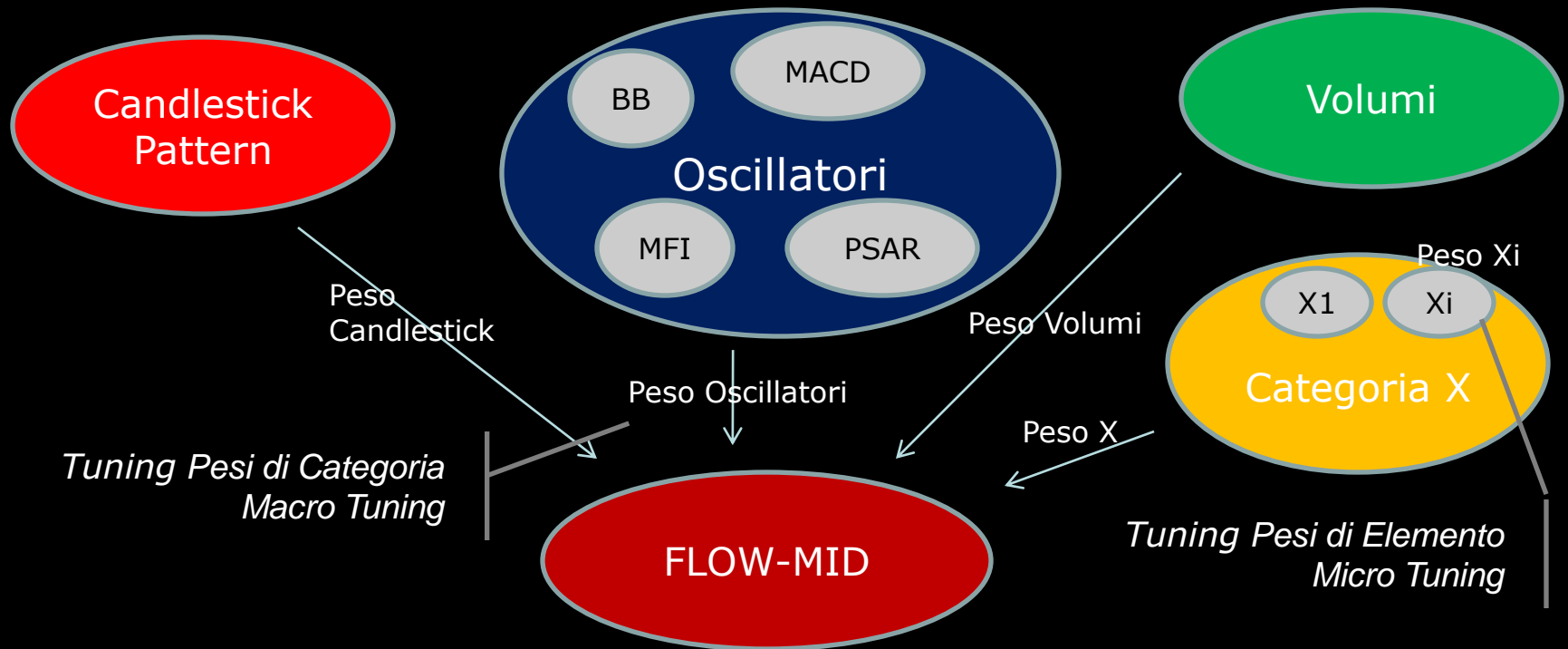


Obiettivo del TS FLOW-MID

Obiettivo del TS FLOW-MID é quello di :

- considerare **piú categorie di segnali** secondo la concezione che tutto é signaling
- rendere quanto piú possibile **automatizzato** il processo di "decisione umana " vista la vastità di elementi da considerare

I singoli segnali che confluiscono nel TS vengono pesati prima per categoria (peso di categoria) poi per peso del segnale base (elemento). Il know-how risiede essenzialmente nella quantificazione dei pesi.



Modello TS FLOW-MID

- Sistema **Multi-Segnale** con quantificazione dello scenario buy e dello scenario sell in un range $[-100:100]$. Buy o sell over soglia limite (es short da -60 a -100)
- I singoli segnali contribuiscono con **un valore positivo o negativo**, indipendentemente dalla ricerca del segnale buy/sell. (es sfioramento BB superiore con candle reversal = -20)
- La risultante del segnale è la **somma dei singoli segnali** e quindi implicitamente dei loro pesi (es precedente 20%)
- Sistema **modulare** che può essere esteso aggiungendo un'altro categoria di segnali o con un singolo segnale e riadattando i pesi degli altri (es precedente da -20 → -18 aggiungendo un altro oscillatore nella categoria degli oscillatori)
- Segnali di tipo **multi-natura**: Candle, Volumi, Oscillatori, Grafici, S9P, Fan e Macchine SW in prima battuta, poi timing metafisico e fondamentale (es dividendi)

Ipotezi Valenza Signal

A livello macro le categorie sono le seguenti. I pesi della categoria costituiranno il macro-tuning del TS

Signal	Valenza	Peso Categoria	Eccezioni
Candlestick Pattern	Teorica	20	Candle Maledette
Oscillatori	Contrarian	10	Alcuni (Bollinger Band e Money Flow ecc...) hanno signal teorico, altri neutrale (=0).
Volumi	Teorica	20	
Grafica	Contrarian	10	Cunei
Gann Fan	Teorica	15	
Gann S9P	Teorica	15	
Macchine Software	Teorica	10	

Pesi Candle

I pesi della candle costituiscono il micro-tuning

Candle	Peso	Eccezioni
Morning Star	20	
Dragon Fly	19	
...	16	