

Metodo "Past Regression Deviated"

Di
Robert Hill

Il metodo Past Regression Deviated è una strategia che si sviluppa dal metodo Jaimo, detto anche metodo Hoover, di Robert L. Royce. Quel metodo usava un canale di regressione, l'incrocio di due EMA 5 e 8, ed il MACD. Ho modificato il metodo utilizzando il Past Regression Deviated, un CCI e gli oscillatori stocastici. L'idea base è che quando il prezzo è lontano dalla linea centrale della regressione, tende a ritornarvi. Si possono considerare le sue linee rosse come livelli di forte ipercomprato/ipervenduto. Il comportamento è simile a quello di altri oscillatori come gli stocastici, l'RSI ed il CCI quando invertono dopo aver raggiunto gli estremi delle bande.

Sebbene questo lavoro sia ancora in fase di sviluppo, l'anno scorso si è rivelato molto profittevole sulla coppia GBP/JPY sul timeframe di 1 ora (H1). Le regole sono facili da seguire e richiede solo pochi indicatori. Regolando opportunamente la parametrizzazione della deviazione standard il metodo dovrebbe funzionare bene su ogni coppia di valute.

INDICATORI

- Past Regression Deviated (da ora PRD): disegna linee che delimitano i canali di regressione
- CCI_Woodies_Lnx_vn_n (attualmente v1_1) : l'indicatore CCI usato dal Woodies CCI Club
- Oscillatori stocastici

Quando all'inizio incominciasti ad usare questo metodo, era Maggio 2008, utilizzavo solamente l'indicatore PRD, con i parametri di default, per l'ingresso in posizione, e il CCI_Woodies_Lnx (parametrizzato 14, 6, 25) per la conferma. Per l'uscita usavo gli stocastici (parametrizzati 5,3,3).

REGOLE DI TRADING

- **Ingresso BUY** (apertura di una posizione LONG)

Quando una candela (1H) chiude fra la linea rosso più bassa e quella arancione inferiore dell'indicatore PRD, attendere che una successiva chiuda SOPRA la linea arancione ~~superiore~~ inferiore. Di solito, a questo punto, l'indicatore CCI provenendo dal basso incrocia la sua linea del -100 fornendo il segnale per l'ingresso BUY.

- **Ingresso SELL** (apertura di una posizione SHORT)

Quando una candela (1H) chiude fra la linea rosso più alta e quella arancione superiore dell'indicatore PRD, attendere che una successiva chiuda SOTTO la linea arancione ~~inferiore~~ superiore. Di solito, a questo punto, l'indicatore CCI provenendo dall'alto incrocia la sua linea del +100 fornendo il segnale per l'ingresso SELL.

- **USCITA DALLA POSIZIONE** (BUY o SELL)

La regola è veramente semplice: se si verificano le condizioni per un ingresso SELL (vedi sopra) si deve uscire da una posizione Buy.

Viceversa, se si verificano le condizioni per un ingresso Buy (vedi sopra) si deve uscire da una posizione Sell.

- **SCALPING**

E' anche possibile utilizzare l'indicatore PRD per fare scalping.

Quando il prezzo colpisce la linea rossa superiore si entra Sell; quando colpisce la linea rossa inferiore si entra Buy.

Non ho provato ma anche nei grafici ad 1 ora (1H) ci sono molti trade che danno piccoli guadagni.

Ciò permette anche degli ingressi migliori quando il segnale di scalping viene confermato quando il segnale di trading incrocia la linea arancione. Sarebbe anche interessante provare lo scalping sui timeframe inferiori.

In tal caso potrebbe essere necessario variare la parametrizzazione del PRD per meglio adattarla alla coppia di valute trattata.

MONEY MANAGEMENT

Per avvantaggiarsi di questo metodo ci sono alcuni approcci.

Si può effettuare un singolo trade uscendo da esso normalmente quando si verifica un segnale contrario o quando viene colpito lo stop loss.

A questo proposito il primo stop loss va messo a livello della linea rossa che sta sotto l'ingresso Buy, o sopra quello Sell. Di solito, per GBP/JPY, provo uno stop loss di 90 pips minimo.

Lo stop loss va spostato man mano che il trade procede (trailing stop).

Questa pratica mi è stata profittevole in passato, ma attualmente un diverso approccio permette l'applicazione di nuove strategie di uscita che comportano pressoché nessun rischio.

L'esempio che segue assume che si faccia trading con 1 lotto standard, ma è facilmente adattabile a chi usa i minilotti o i microlotti.

Preferisco effettuare svariati trade con un target per ognuno di essi. Dunque anziché effettuare 1 solo trade da 1 lotto, si potrebbero usare minilotti in svariati trade. In tal caso il primo trade impegnerebbe 5 minilotti (il 50% dell'esposizione); il secondo trade impegnerebbe i rimanenti 5 minilotti (l'altro 50%).

Se si preferisce si potrebbe effettuare più trade usando combinazioni di minilotti come 5-3-3, oppure 4-3-3, o anche 4-2-2-1-1.

L'obiettivo del primo trade è costituito dalla linea gialla intermedia. Quello del secondo è sulla linea rossa opposta (cioè al di là della gialla) partendo dall'ingresso. Il terzo trade viene lasciato correre fino a che si verifica un segnale opposto, o se viene colpito uno (trailing)stop loss.

Si potrebbero usare anche più combinazioni di esposizione, considerando comunque obiettivi la linea gialla, la verde, l'arancione e la rossa, per poi finire attendendo un segnale d'inversione o il raggiungimento di un (trailing)stop loss.

Questa pratica permette di settaggi del profit separati per ogni trade, con uno spostamento del trailing stop a pareggio + l'aggancio ad ogni trade che rimane aperto, dopo che il primo obiettivo è raggiunto o *si effettua un normale trailing al primo obiettivo* (?!).

L'Expert Advisor "TrailingWithPartialClose" può essere profittevolmente utilizzato a questo scopo.

ESEMPI

Il grafico sottoriportato mostra i trade che sono stati effettuati dal 29 Aprile al Maggio 2009.

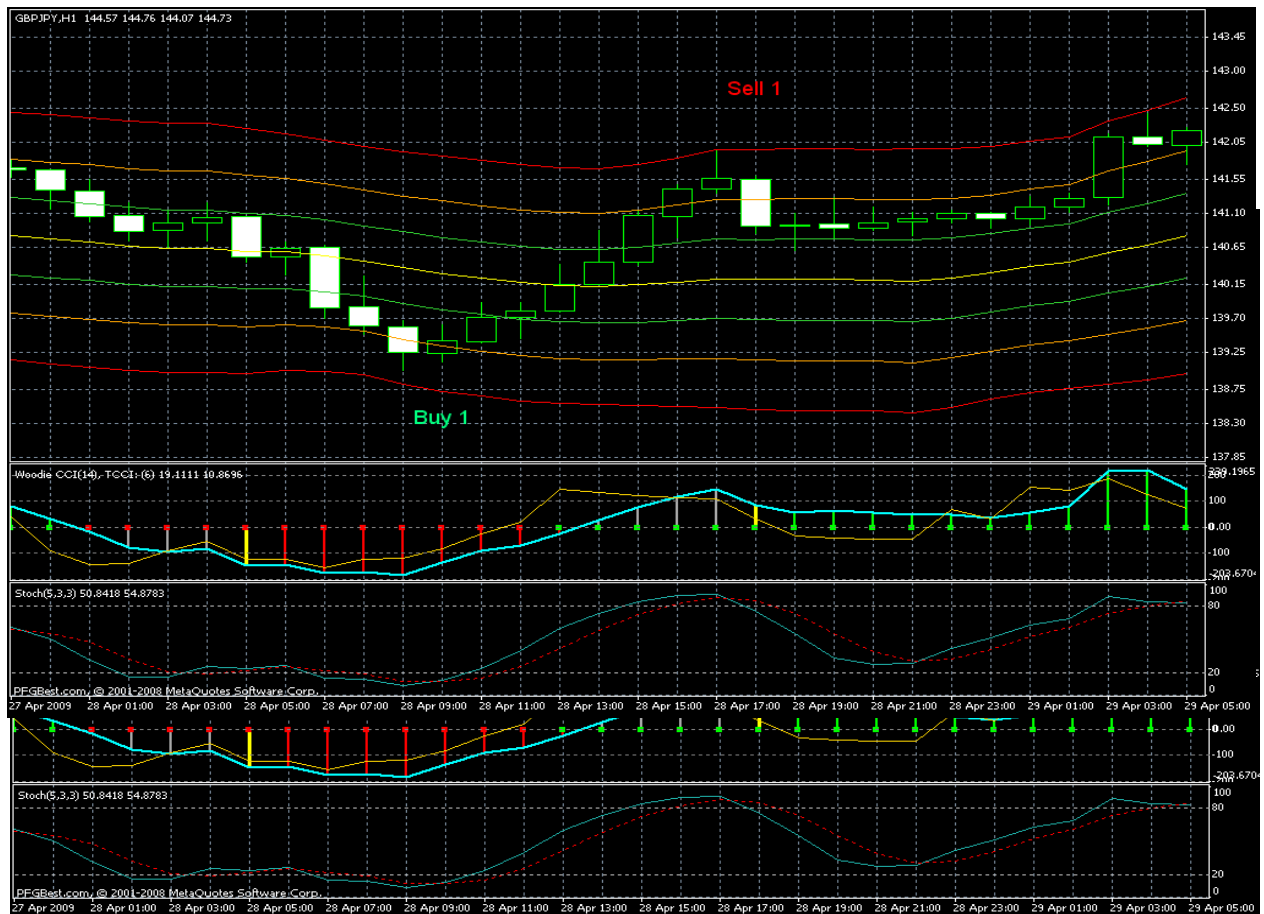


Grafico 1

Il primo segnale d'ingresso, Buy 1 nel grafico 1, è stato un Buy alle 10:00 del 28 Aprile. Il prezzo d'ingresso era 139,45 compreso di spread. Lo stop loss che sarebbe stato sulla linea rossa a livello 138,83 risultava troppo stretto e dunque è stato impostato a 138,55. Normalmente avrei effettuato due ordini. Il primo avrebbe avuto il profit impostato come primo obiettivo la linea gialla, a 140,30, per circa 85 pips potenziali. Se si effettuano ordini multipli gli obiettivi sono la linea gialla a 140,30, la linea verde più alta a 140,86, l'arancione più alta a 141,27 e quella rossa alta a 141,87. Quando sorveglio i trade dal vivo uso queste linee obiettivo ma considero il valore nel momento in cui il prezzo raggiunge la linea. Uso le linee anche per spostarci gli stop loss.

La prima chiusura parziale è capitata alle 13:00 quando il prezzo ha raggiunto la linea gialla a 140,16 . In questo punto ho voluto chiudere la mia prima posizione con un profitto di 71 pips. Dopodichè sposto lo stop loss della posizione rimanente sulla linea arancione più bassa, oppure lo blocco a 10 pips di distanza, a seconda di come risulta meglio. La linea arancione più bassa era a 139,17 e dunque ho spostato lo stop a 139,55 per bloccarlo a 10 pips.

Il segnale d'uscita è arrivato alle 19:00 quando il Bid era a 140,93; è indicato dalla scritta "Sell1". Il secondo trade è stato chiuso con un profitto di 148 pips. Se si effettuano 3 trade la seconda uscita è quando il prezzo colpisce la linea rossa a 141,85 con un profitto di 240 pips. Il terzo trade allora chiuderebbe con un profitto di 148 al primo segnale utile.

Impegnando 1 lotto il segnale d'uscita avrebbe fornito netti 148 pips. Effettuando due trade con il primo obiettivo e poi l'uscita definitiva, fornirebbe un netto di $(71+148) \cdot 2 = 109$ pips. Con tre trade, ed usando minilotti in formazione 4,4,2 , si sarebbero ricavati netti $71 \cdot 0,4 + 240 \cdot 0,4 + 148 \cdot 0,2 = 154$ pips.

Dopo questa prima fase ho effettuato un ordine Sell per 1 trade a 140,93 con stop loss a 141,95. Questo trade è risultato in perdita di 102 pips.



GRAFICO 2

Un altro segnale Sell (Sell2 sul grafico) si è presentato alle 7:00 di Aprile. Il prezzo d'ingresso è stato a 142,19 con stop loss a 142,95. Questo trade è risultato in un'altra perdita di 81 pips.

Un ulteriore segnale di Sell è capitato alle 15:00 di Aprile. L'ingresso è stato a 143,10 con uno stop loss di 144,05. Questo trade raggiunse la linea mediana gialla prima d'invertire. La prima metà è stata chiusa a 142,20 più 5 pips di spread per un profitto di 85 pips; lo stop loss è stato allora spostato a 143,00 . Il secondo trade è stato chiuso con un guadagno di 10 pips.



GRAFICO 3

Un altro segnale di Sell (Sell 4) si è verificato alle 12:00 del 30 Aprile. Il prezzo d'ingresso è stato di 145,51 con uno stop loss sulla linea rossa a 146,14. Lo stop loss è stato impostato a 146,41 . Il trade ha raggiunto la linea mediana gialla a 145,30 . La prima metà del trade si è chiusa con un profit di 21 pips e lo stop loss è stato spostato a 145,41. Questo stop loss è stato colpito nella seconda metà del trade per un profit di 10 pips.

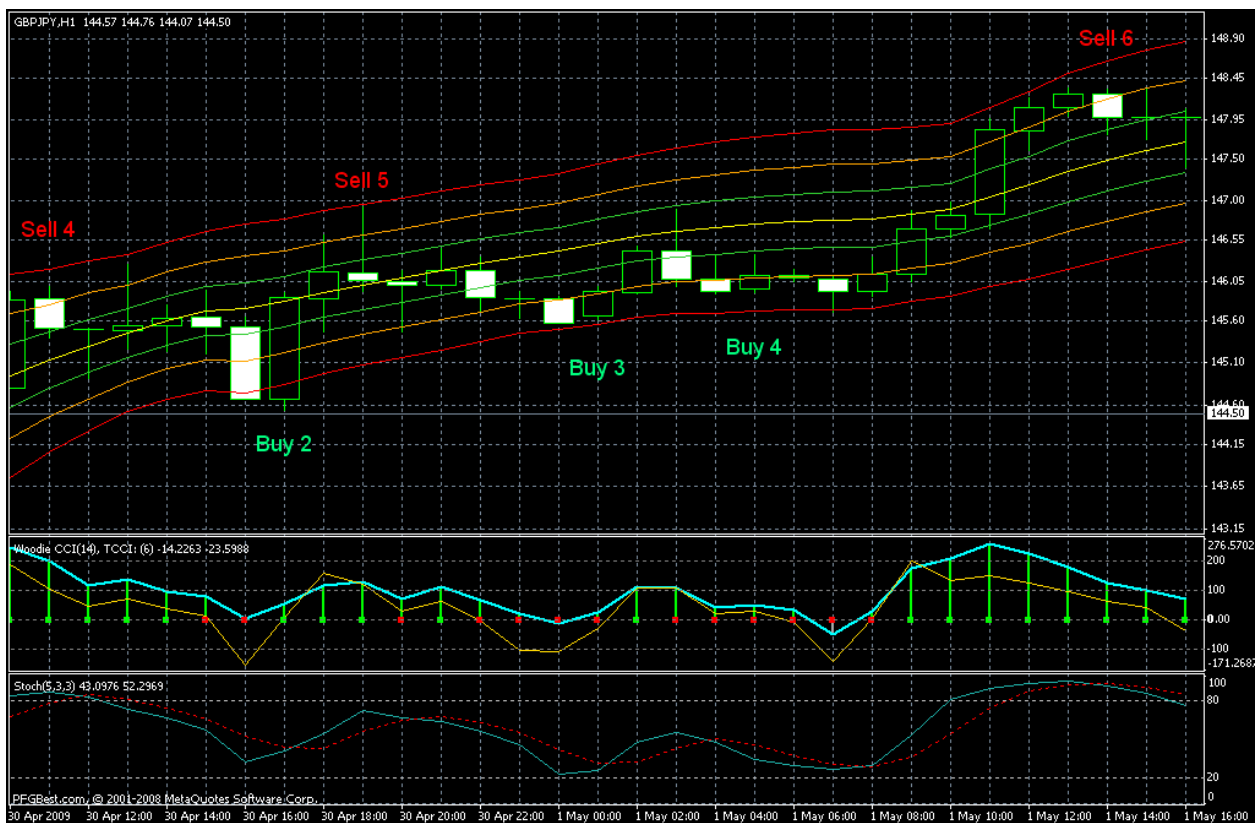


GRAFICO 4

Il successivo segnale è stato un Buy (Buy 2) capitato alle 18:00 del 30 Aprile. Il prezzo d'ingresso è stato a 145,92 con uno stop loss a 144,75 secondo la linea rossa. Il trade si è chiuso al successivo segnale di Sell quando il prezzo era a 146,07, per un profitto di 15 pips.

Il segnale Sell alle 20:00 del 30 Aprile è stato al prezzo di 146,07 con uno stop loss a 146,96. Il trade si è chiuso con il successivo segnale alle 2:00 del 1 Maggio (Buy 3) quando l'Ask era 145,94. Il profit di questo trade è stato di 13 pips.

Il successivo segnale Buy (Buy 3) è stato al prezzo di 145,94 con un possibile stop loss a 145,55. Tuttavia si è considerato troppo stretto e così è stato impostato a 145,04. Quando il prezzo ha raggiunto la linea centrale gialla a 146,59 la prima metà del trade è stata chiusa per 63 pips di profitto a lo stop loss è stato spostato a 146,04. La seconda metà del trade è stata stoppata con 10 pips di profitto.

Alle 6:00 del 1 Maggio c'è stato un segnale Buy (Buy 4) al prezzo di 146,18 con uno stop loss a 145,71. Ancora è stato considerato troppo stretto e è stato impostato a 145,28. Quando il prezzo ha raggiunto la mediana appena prima dell'apertura della Sessione Europea. La prima metà è stata chiusa a 146,85 con un profitto di 67 pips, e lo stop loss è stato spostato a 146,28. Dopo un movimento molto grande del prezzo lo stop loss è stato portato a 147,21, cioè a circa metà sotto la candela lunga. Il trade si è chiuso nel punto Sell 6 del grafico con un profitto, per questa seconda metà del trade, di 181 pips.



GRAFICO 5

Il trade Sell (punto Sell 6) è stato aperto alle 15:00 del 1 Maggio al prezzo di 147,99 con uno stop loss che sarebbe stato sulla linea rossa, a livello 148,50 . Tuttavia lo stop loss è stato impostato a 148,89 . Quando il prezzo ha incrociato la mediana gialla a 147,70 è stata chiusa metà della posizione per un profit di 24 pips e lo stop loss è stato impostato a 147,89 . La seconda metà è risultata stoppata con 10 pips di profitto.



GRAFICO 6

Il successivo segnale di trade è stato il Buy 5 alle 17:00 del 4 Maggio. Il prezzo d'ingresso era 148,34 con uno stop loss a 147,52. Il prezzo ha finalmente incrociato la mediana gialla alle 9:00 del 5 Maggio. A questo punto è stata chiusa metà posizione a 148,88 per 54 pips di profitto e lo stop loss è stato portato a 148,44. Alle 15:00 lo stop loss è stato spostato a 149,00 . Il trade è stato stoppato con la successiva candela per un profitto a 66 pips.

Poche ore più tardi il prezzo è sceso di 200 pips prima che capitasse un altro segnale. Poiché su questa discesa non c'è più stato un segnale di Sell non è stato effettuato alcun trade.

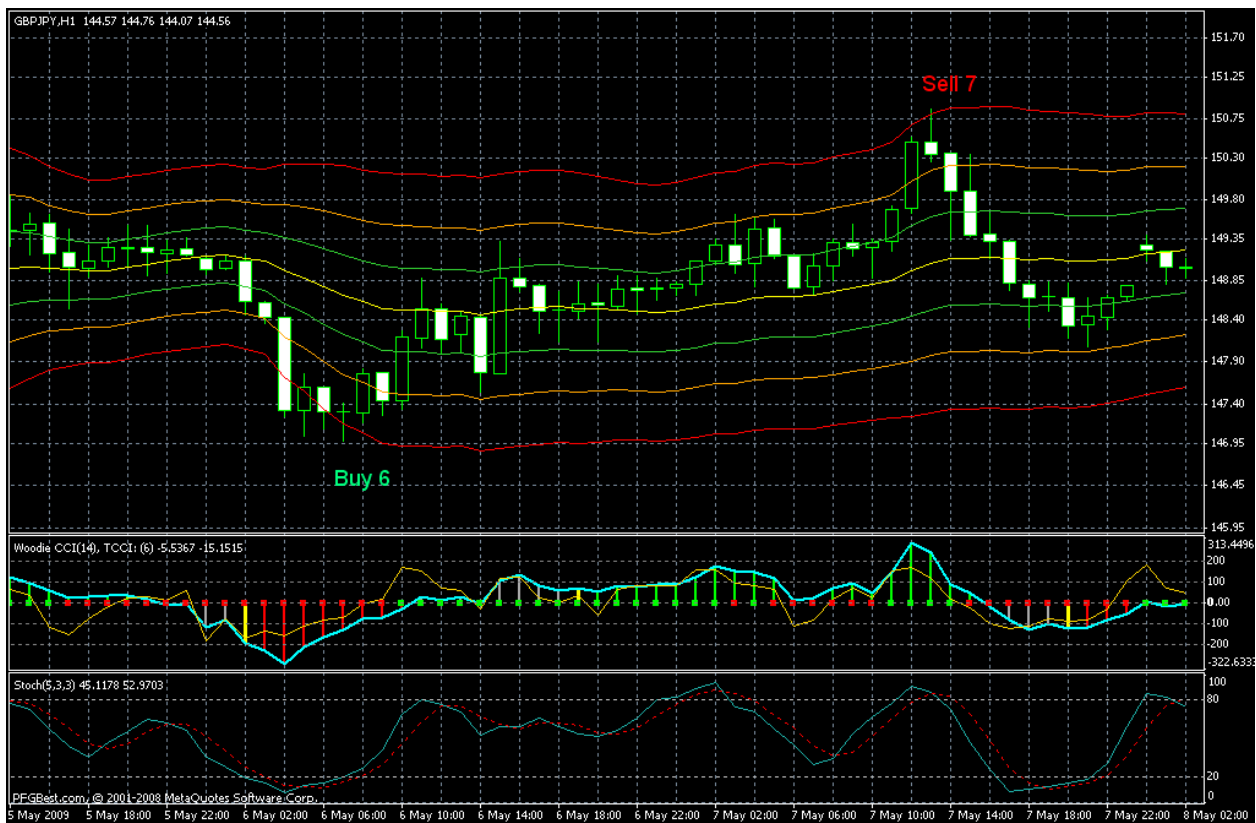


GRAFICO 7

Il successivo segnale è stato un Buy alle 9:00 del 6 Maggio (Buy 6), Il prezzo d'ingresso era 147,77 con uno stop loss sulla linea rossa a 147,06 . Tuttavia è stato impostato a 146,87 . Alle 12:00 è stata chiusa metà posizione a 148,53 per un profitto di 88 pips, e lo stop loss è stato portato a 147,50 . Alle 4:00 del 7 Maggio lo stop loss è stato spostato a 148,59. Il trade è stato stoppato prima che il prezzo salisse di nuovo, per una uscita finale alle 15:00 del 7 Maggio quando il prezzo era 149,90 per un piacevole profitto di 213 pips.

Il successivo segnale Sell di trade è stato raccolto a 149,90 con uno stop loss a 150,87 . Alle 18:00 il prezzo ha raggiunto la mediana gialla e dunque è stata chiusa metà a posizione a 148,83 per un profitto di 107 pips. Lo stop loss è stato allora spostato a 149,80 . Alle 7:00 dell' 8 Maggio lo stop è stato ulteriormente spostato a 149,25 ed il trade è stato stoppato poche ore dopo per un profitto di 65 pips.



GRAFICO 8

Il successivo segnale si è presentato alle 2:00 dell' 11 Maggio (Sell 8). Il prezzo di apertura è stato di 149,45 con uno stop loss a 150,71 . Alle 7:00 è stata chiusa metà posizione a 149,51 per un profitto di 44 pips e lo stop loss spostato a 150,38 . Il mercato era in laterale con la resistenza superiore sulla linea verde. Dopo che il ribasso si concluse alle 13:00 lo stop loss è stato spostato a 149,18 . Il prezzo ha continuato a scendere fino al ritracciamento avvenuta all'incrocio con al linea arancione inferiore per un segnale di uscita a 147,62 ed un profitto di ben 233 pips.

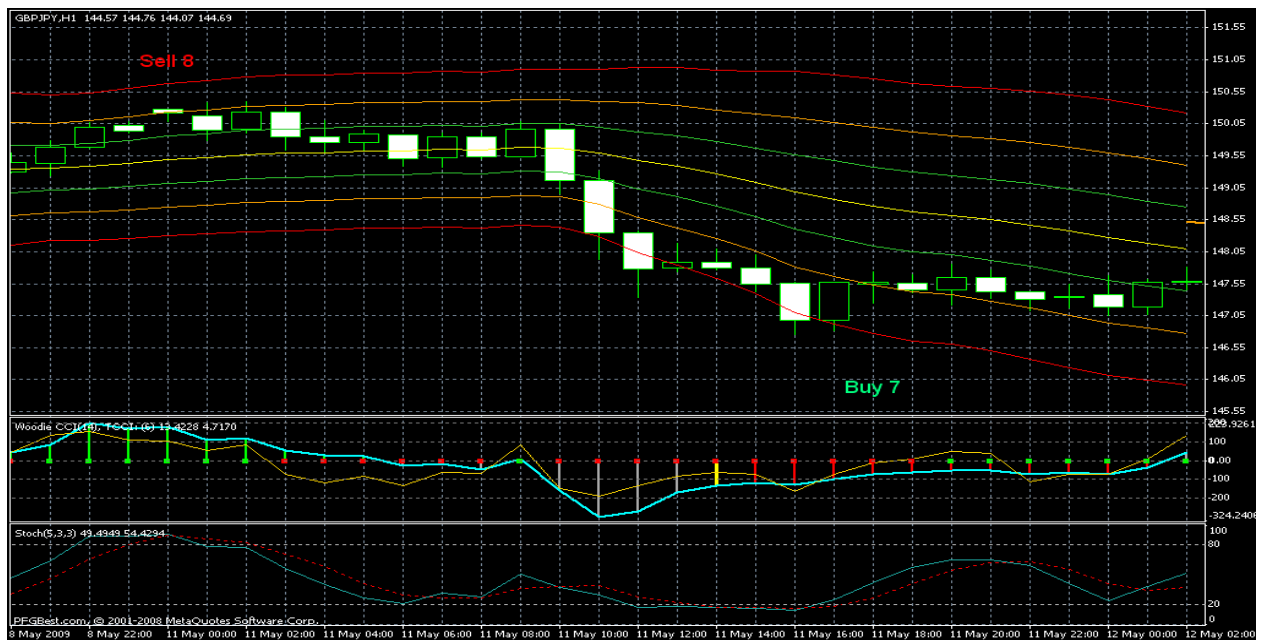


GRAFICO 9

Un trade Buy è stato iniziato alle 18:00 del 11 Maggio, al prezzo di apertura di 147,62 con uno stop loss a 146,76.



Il trade Buy è stato stoppato alle 5:30 circa del 12 Maggio con una perdita di 86 pips. Un ulteriore segnale Buy è stato iniziato poche ore dopo (Buy 8). Il prezzo d'apertura è stato 147,06 con lo stop loss sulla linea rossa a 145,74 . Questo livello era troppo largo e quindi lo stop loss è stato impostato a 146,16 . Il movimento era molto forte quando il prezzo ha incrociato la mediana gialla e così si è aspettato fino alla chiusura della candela delle 11:00 . In quel momento lo stop loss è stato spostato a 147,80 a circa la metà della candela lunga bloccando a 74 pips l'intera posizione. Il segnale d'uscita si è verificato durante la presentazione ma si era già usciti prima delle 12:00 sulla linea rossa al prezzo di 149,41 per un profitto di 235 pips. Ci si è concentrati sulla presentazione.

E' stato mancato l'ingresso sell Sell 9 capitato durante la presentazione. Il prezzo d'ingresso sarebbe stato a 148,43 con uno stop loss di 149,46 . Il prezzo è sceso fin sotto la mediana gialla cosicché si sarebbe chiusa mezza posizione alle 20:00 al prezzo di 146,41 per un profitto di 202 pips. Lo stop loss sarebbe stato spostato a 148,33 .



GRAFICO 11

Il prezzo ha fatto un'altra gradevole discesa il 13 Maggio quando lo stop loss ha potuto essere spostato sulla mediana gialla a 146,90 . L'uscita finale è stata alle 16:00 quando si è verificato il segnale d'uscita Buy 9. Il trade è stato chiuso con un profit di 294 pips.

Il trade Buy aperto a 145,49 con uno stop loss a 144,62 . Il trade è stato stoppato con una perdita di 87 pips. Il successivo Buy alle 0:00 aperto a 144,40 con uno stop loss a 143,58 . Il mercato era piatto dopo un movimento molto grande proveniente da molto in alto il 7 Maggio, e per via delle notizie che stavano per uscire il trade è stato chiuso quando il prezzo ha incrociato la linea verde a 145, 02 per 40 pips di profit.

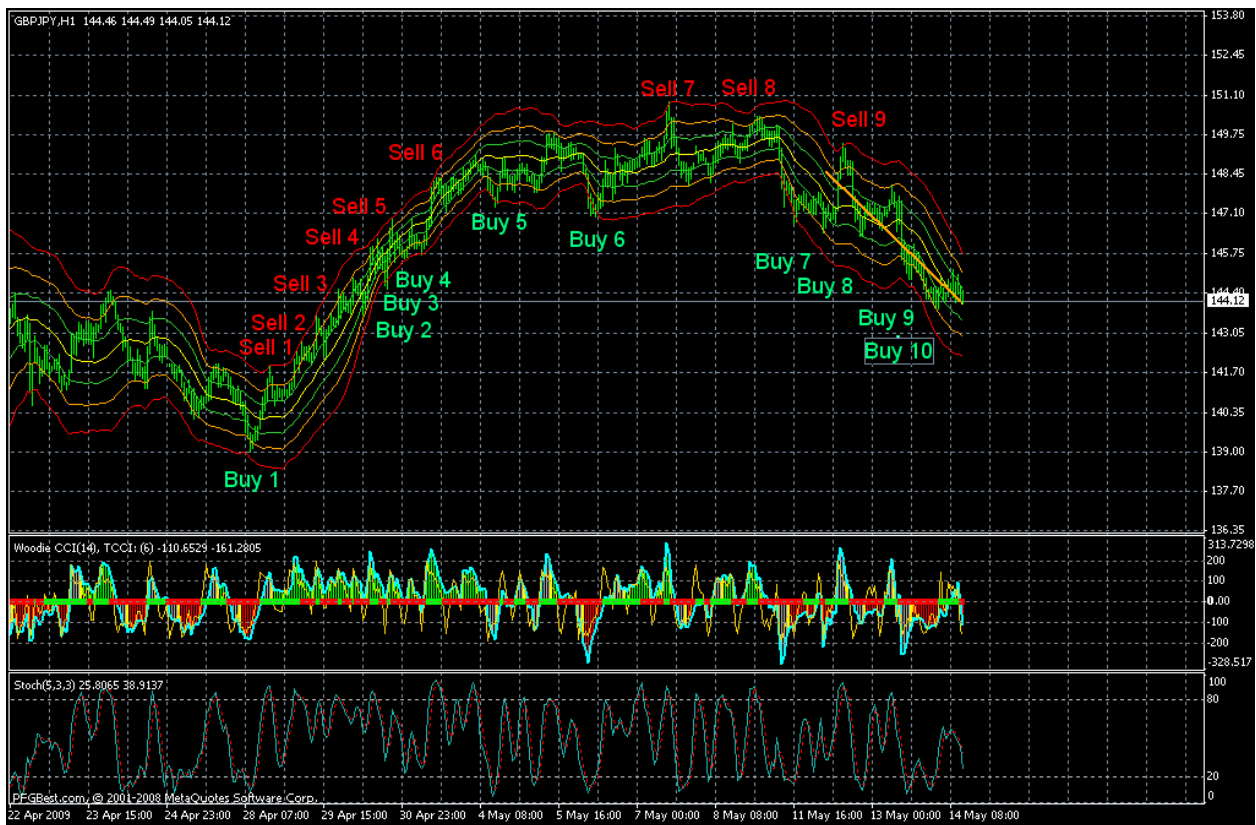


GRAFICO 12

Il grafico che mostra tutto il periodo di questo studio.

I primi 6 trade Sell sono stati contro trend, I successivi 2 sell sono capitati durante un mercato laterale e quelli finale durante un trend al ribasso.

I primi trade Buy sono capitati durante un trend d'inversione. I successivi 3 durante un trend al rialzo, altri due durante un mercato laterale ed i 4 finali sono stati contro trend.

Buy 1 71 + 148 = 219
 Buy 2 15 + 15 = 30
 Buy 3 63 + 10 = 73
 Buy 4 67 + 181 = 248
 Buy 5 54 + 66 = 110
 Buy 6 88 + 213 = 310
 Buy 7 -86 - 86 = -172
 Buy 8 235 + 235 = 470
 Buy 9 -87 - 87 = -174
 Buy 10 40 + 40 = 80

Sell 1 -102 - 102 = -204
 Sell 2 -81 - 81 = -162
 Sell 3 85 + 10 = 95
 Sell 4 21 + 10 = 31
 Sell 5 13 + 13 = 26
 Sell 6 24 + 10 = 34
 Sell 7 107 + 65 = 172
 Sell 8 44 + 233 = 277
 Sell 9 202 + 294 = 496

Total Net Buy = 1540 – 346 = 1194 pips.

Total Net Sell = 1131 – 366 = 765

Pips totali dal 28 Aprile al 13 Maggio (due settimane) = 1959 , con 15 guadagni e 4 perdite.