

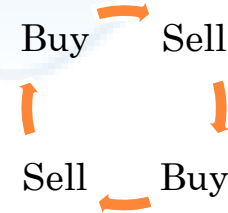
Il trading automatico con WIMSERVER

Ing. Giuseppe Belfiori

FT Support
From trading To trading system

IL TRADING AUTOMATICO

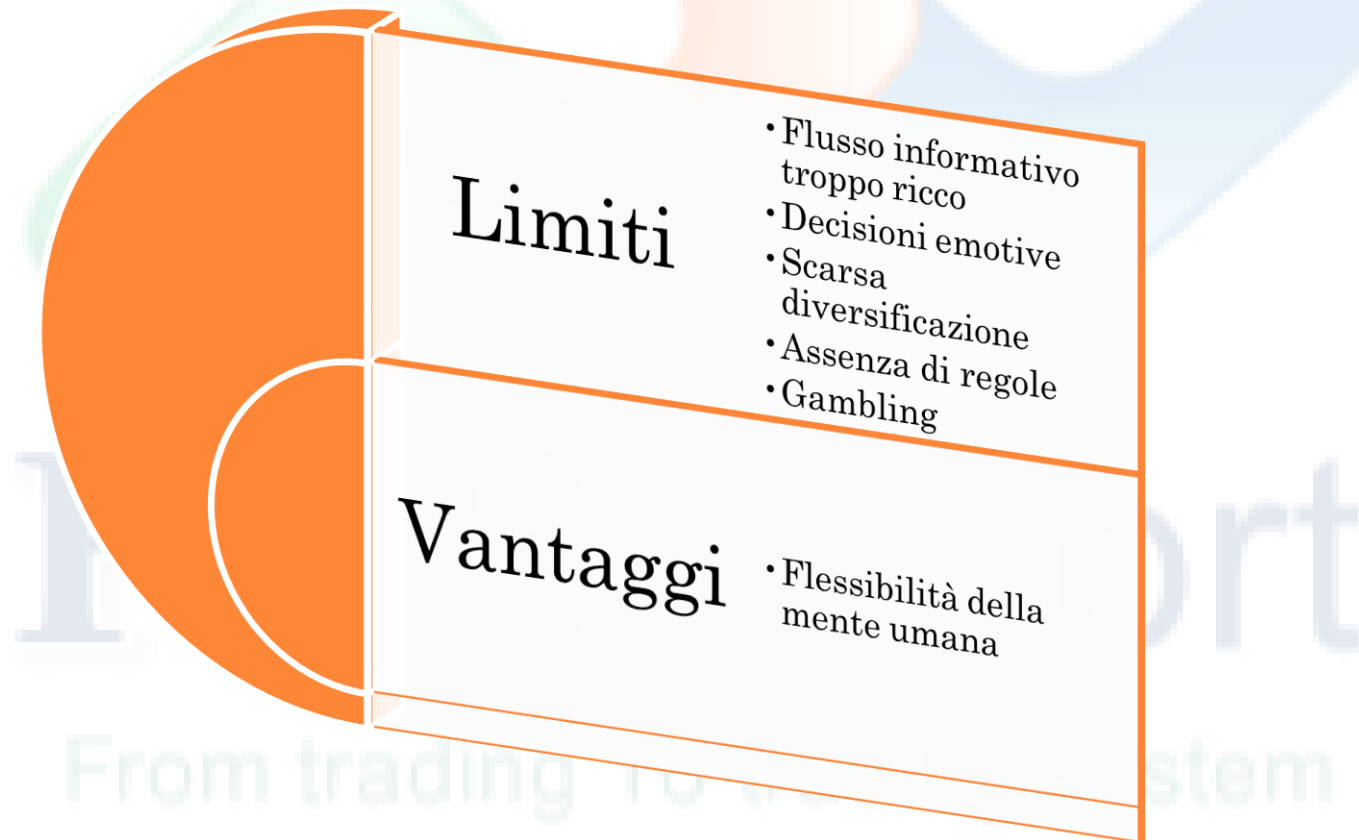
Il processo decisionale del trader discrezionale



FT Support
From trading To trading system

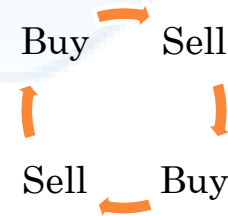
IL TRADING AUTOMATICO

Il processo decisionale del trader discrezionale



IL TRADING AUTOMATICO

Il processo decisionale del trader automatico



Realizzazione delle strategie



IL TRADING AUTOMATICO

Il processo decisionale del trader automatico



IL TRADING AUTOMATICO

Il processo decisionale del trader automatico



- Contiene le strategie di trading
- Genera i segnali operativi
- È completamente automatizzata

FT Support
From trading To trading system

IL TRADING AUTOMATICO

Analisi Tecnica:

osservazione e studio del mercato



Strategia:

pianificazione delle operazioni



Software:

esecuzione delle operazioni

ANALISI TECNICA

Nei prezzi e nel loro andamento è contenuto tutto il pensiero del mercato

Lo studio delle serie storiche permette di stabilire comportamenti probabilistici dei mercati

Dai comportamenti dei mercati è possibile stabilire regole di trading

STRATEGIA

Pianificare le proprie mosse sul mercato

Stabilire cosa, quanto e quando movimentare

Rispettare la strategia

SOFTWARE

Per lo studio dei mercati:
Tradestation, Metastock

Per la raccolta dei dati:
WIMServer

Per l'esecuzione degli ordini:
WIMServer

WIMSERVER PER TRADESTATION



simbolo	tick	ora	bid	ask	lot
EURUSD	1	18.08.07	1.050	5.11	1000
GBPUSD	2	18.08.07	4.000	4.77	4.705
USDJPY	1	18.08.08	124	124.90	100
EURJPY	1	18.08.08	124.2	124.25	24.2
USDCHF	1	18.08.08	200	21.3	100
EURCHF	1	18.08.08	102	22.1	100
GBPCHF	1	18.08.08	10	9.80	1000
USDINR	1	18.08.08	100	18.75	18.80
EURINR	1	18.08.08	100	16.00	16.1
GBPINR	1	18.08.08	100	2.00	2.00

Real time (funziona anche con Metastock pro)

- 100 simboli: gestione combinata con WIMServer per Metastock
- Connessione socket dedicata
- Funzionamento sulle 24 ore
- Avvio automatico di tutti i software connessi
- Nessun settaggio per separatori decimali e migliaia

simbolo	mercato	data	ora
EURUSD	FX	18.08.07	10:00
GBPUSD	FX	18.08.07	10:00
USDJPY	FX	18.08.07	10:00
EURJPY	FX	18.08.07	10:00
USDCHF	FX	18.08.07	10:00
EURCHF	FX	18.08.07	10:00
GBPCHF	FX	18.08.07	10:00
USDINR	FX	18.08.07	10:00
EURINR	FX	18.08.07	10:00
GBPINR	FX	18.08.07	10:00

Dati Storici

- Daily senza limiti temporali, 1 e 5 minuti
- Tutti i simboli del Global Server
- Gestione automatica dello scarico a grafici aperti
- Scarico contemporaneo di tutti i time frame con periodi temporali diversi

ora	simbolo	oper.	qtà	workspace	info
18.31.35	EURUSD	vend	1	Ordini Automatici	ID ordine 44000365
18.31.35	EURUSD	vend	1	Ordini Automatici	ID ordine 44000369
18.31.34	EURUSD	comp	6	Ordini Automatici	ID ordine 44000328
18.31.32	EURUSD	comp	1	Ordini Automatici	ID ordine 44000313
18.31.31	EURUSD	vend	1	Ordini Automatici	ID ordine 44000300
18.31.30	EURUSD	vend	1	Ordini Automatici	ID ordine 44000274
18.31.29	EURUSD	vend	1	Ordini Automatici	ID ordine 44000257
18.31.28	EURUSD	vend	1	Ordini Automatici	ID ordine 44000241

Ordini automatici

- Ordini a mercato in 0.5 sec
- Conferma e numero dell'ordine
- Nessun limite agli Workspaces né per il nome né per la quantità
- Abilitazione in tempo reale di ciascun workspace



COSTRUZIONE DI UN TRADING SYSTEM

From trading To trading system

COSTRUZIONE DI UN TRADING SYSTEM

- Scelta dell'indicatore, oscillatore, tecnica su cui basare il sistema
- Determinazione della regola principale del sistema
- Analisi qualitativa della regola
- Aggiunta delle tecniche di money management
- Analisi quantitativa
- Applicazione in real time con ordini automatici

COSTRUZIONE DI UN TRADING SYSTEM

- Bande di Bollinger
- Apriamo una posizione Long se il prezzo chiude al di sotto della banda inferiore e poi rompe al rialzo la stessa: 2 deviazioni standard
- Buy Order in EasyLanguage
- IF C Crosses above BollingerBand(C,20,-2) then buy at market;

COSTRUZIONE DI UN TRADING SYSTEM

- Bande di Bollinger
- Apriamo una posizione corta se il prezzo chiude al di sopra della banda superiore poi rompe al ribasso la stessa: 2 deviazioni standard
- Sell Short Order in MFL (Metastock Formula Language)
- IF C Crosses below BollingerBand(C,20,2) then sell at market;

COSTRUZIONE DI UN TRADING SYSTEM

Analisi Qualitativa della strategia di trading



COSTRUZIONE DI UN TRADING SYSTEM

- Bande di Bollinger: regole di money management, take profit
- Chiudiamo una posizione lunga se il prezzo chiude al di sopra della banda superiore: 1 deviazione standard
- Exitlong in EasyLanguage
- IF Marketposition = 1 and C Crosses above BollingerBand(C,20,1) Then Exitlong at market;

COSTRUZIONE DI UN TRADING SYSTEM

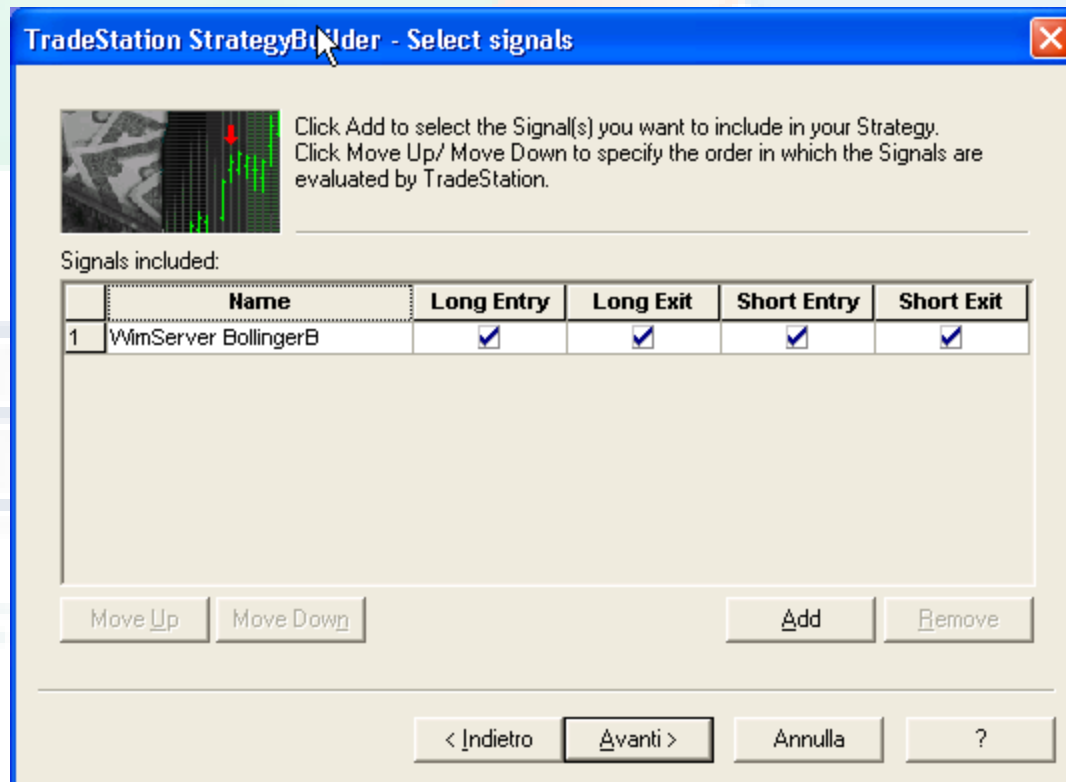
- Bande di Bollinger: regole di money management, take profit
- Chiudiamo una posizione corta se il prezzo chiude al di sotto della banda inferiore: 1 deviazione standard
- ExitShort in EasyLanguage
- IF Marketposition = -1 and C Crosses below BollingerBand(C,20,-1) Then Exitshort at market;

COSTRUZIONE DI UN TRADING SYSTEM

- Bande di Bollinger: regole di money management, Stop loss
- Inseriamo una perdita massima del 3% (grafico daily)
- If Marketposition = 1 Then Exitlong at $\text{entryprice} * 0.97$ stop;
- If Marketposition = -1 Then Exitshort at $\text{entryprice} * 1.03$ stop;

COSTRUZIONE DI UN TRADING SYSTEM

- Trasformo il Signal in Strategy: StrategyBuilder



Costruzione di un Trading System



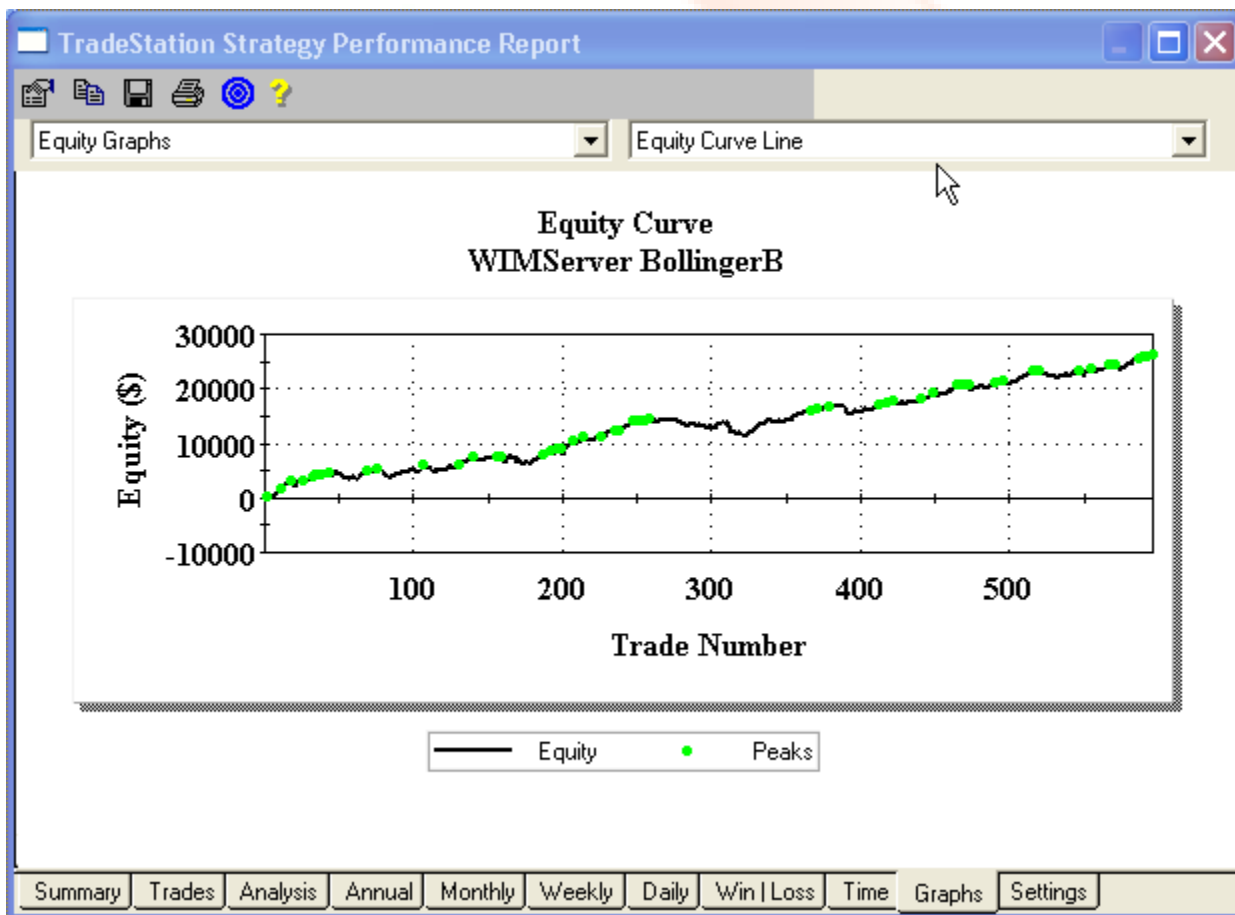
TradeStation Strategy Performance Report - WIMServer BollingerB ES200606-60 min. (10/07)

Performance Summary: All Trades

Total Net Profit	\$26,400.00	Open position P/L	(\$375.00)
Gross Profit	\$71,950.00	Gross Loss	(\$45,550.00)
Total # of trades	596	Percent profitable	70.97%
Number winning trades	423	Number losing trades	173
Largest winning trade	\$925.00	Largest losing trade	(\$1,225.00)
Average winning trade	\$170.09	Average losing trade	(\$263.29)
Ratio avg win/avg loss	.65	Avg trade (win & loss)	\$44.30
Max consec. Winners	13	Max consec. losers	4
Avg # bars in winners	12	Avg # bars in losers	31
Max intraday drawdown	(\$3,487.50)	Max # contracts held	1
Profit Factor	1.58	Return on account	756.99%
Account size required	\$3,487.50		

Summary Trades Analysis Annual Monthly Weekly Daily Win/Loss Time Graphs Settings

Costruzione di un Trading System



Win Consulting & FT Support

✚ Dal 1993...

- ✚ Analisi Mercati finanziari e delle commodity
 - ✚ Software Analisi tecnica
 - ✚ Sviluppo trading system
- ✚ Sviluppo Software per trading automatico
- ✚ Formazione

FT Support: prodotti per il trading

- ✦ WIM SERVER
- ✦ Tradestation 2000i
- ✦ Metastock Professional
- ✦ FT Market Making
- ✦ FT Portfolio Analyzer
- ✦ FT Backoffice
- ✦ Trading System
- ✦ Formazione

TRADING SYSTEM

Strategie automatiche per il trading
.....Decidere è più semplice.....

FT Support
From trading To trading system

WIMSERVER

Software per il trading automatico



.....tradare è più semplice.....

DOW JONES



www.ftsupport.it - info@ftsupport.it -
0289452666

Quando si fa trading ogni giorno c'è una decisione da prendere: buy or sell?

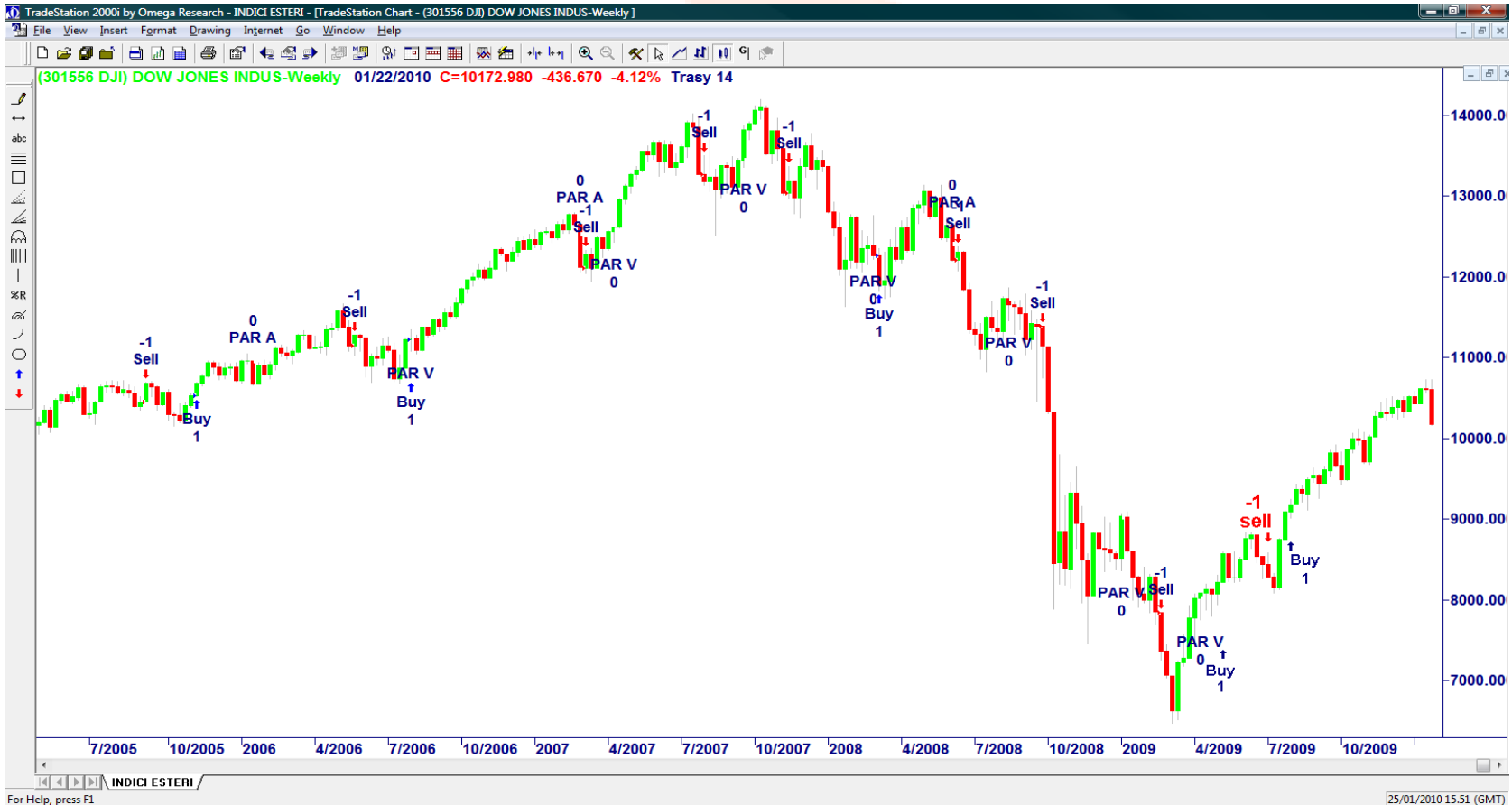
DOW JONES



www.ftsupport.it - info@ftsupport.it -
0289452666

L'impiego di una semplice media mobile semplifica la scelta : buy / sell, ma lascia la discrezionalità

DOW JONES



www.ftsupport.it - info@ftsupport.it -
0289452666

L'impiego di un trading system elimina la discrezionalità, da l'indicazione buy/sell, rende il trading più efficiente

30

Tutti i mercati in un clic



Con **IWBank** 

Con Wimservers



FT Support
From trading To trading system

Il Trading automatico

Il numero elevato di strumenti finanziari, i mercati aperti 24/24, la frequenza ravvicinata delle scadenze dei future...permettono di sviluppare interessanti strategie di trading.

FT Support
From trading To trading system

Il Trading automatico

Grazie a WIMServer, disponibile per tutti i clienti IWBANK, è possibile automatizzare queste strategie e cogliere appieno le opportunità offerte su tutti i mercati.

FT Support
From trading To trading system

Il Trading automatico

- ✚ Monitoraggio in tempo reale di tutti i contratti
- ✚ Invio automatico degli ordini al verificarsi delle condizioni impostate in Tradestation e/o Metastock
- ✚ Gestione attiva degli ordini per la massima precisione operativa
- ✚ Recupero dei dati storici

Il Trading automatico

- ✚ Possibilità di operare su più strumenti
- ✚ Possibilità di eseguire contemporaneamente più strategie
- ✚ Diversificazione
- ✚ Precisione
- ✚ Meno stress
- ✚ Riduzione del rischio operativo

Novità 2010

FT Market Maker

Gli spread presenti su ETC, obbligazioni e altri strumenti aprono al trader opportunità per un trading particolare atto a chiudere gli spazi presenti tra bid e ask.

Per far ciò è necessario un software capace di monitorare il mercato e gestire automaticamente gli ordini in funzione del book di negoziazione.

Vile pecunia...

- Wimserver è noleggiato direttamente da IWBANK;
- È possibile provarlo per un mese (vedasi sul sito IWBank le regole per il periodo di prova) a patto che si utilizzi Quick Trade unitamente a TradeStation o Metastock Professional
- Il canone di Wimserver è di:
 - 60 euro/mese per la versione base
 - 90 euro/mese per la versione professional
- Per conoscere TradeStation o Metastock potete telefonare direttamente a FT Support.
- I prezzi di acquisto, una tantum e già inclusivi di iva, sono:
 - 1650€ TradeStation
 - 1500€ Metastock Professional

WIMSERVER PRO



- Ordini market, limit, stop-market e stop-limit
- Gestione evoluta degli ordini parzialmente eseguiti o non eseguiti
- Tre tecniche per ottimizzare l'esecuzione degli ordini e ridurre lo slippage

WIMSERVER PRO

- Alimentazione del Global Server indipendente
- Possibilità di alimentare il Global Server da QT
- Possibilità di scindere il simbolo di alimentazione dal simbolo di negoziazione. Questa funzione permette di operare su strumenti derivati illiquidi (opzioni, ad esempio) partendo dal movimento del sottostante.

WIMSERVER PRO

- Configurazioni memorizzabili per il real time
- Possibilità di cambiare la configurazione dei titoli in tempo reale con un solo click
- Possibilità di specificare il tick per la negoziazione degli strumenti derivati ed esteri
- Gestione automatica e dinamica del tick di borsa secondo le specifiche TradeElect per i titoli MTA

WIMSERVER PRO

- Configurazioni memorizzabili per il recupero dati storici
- Recupero dati storici in un click
- Gestione completamente automatica della chiusura e riapertura workspaces

WIMSERVER PRO

- Possibilità di comporre e salvare diversi layout
- Layout facilmente richiamabili
- Personalizzazione di tutte le finestre grazie alle potenti funzioni di filtro e organizzazione dei dati

WIMSERVER PRO

- **Tecnologia .Net**
- Robustezza, affidabilità e
SEMPLICITA'
- Funzionamento sulle 24 ore
- Riconnesione automatica in
caso di momentaneo default di
QT

Per saperne di più

FT Support

tel. 0289452666

e-mail :

info@ftsupport.it

Buon trading

grazie dell'attenzione
Ing. Giuseppe Belfiori
g.belfiori@ftsupport.it

FT Support
From trading To trading system