



Web Partners:



	Italian Desk

organizza

2° MASTER su “Trading Systems e Future Trading” Dolomiti di Brenta 2010

29, 30, 31 Maggio 2010

Hotel Villa di Campo, Comano Terme (Trento)

Docenti: Enrico Malverti*, Francesco Caprioglio**



PROGRAMMA E DESCRIZIONE DELL' EVENTO

Un evento unico in Italia in un contesto di rara bellezza ubicato nella cornice delle Dolomiti di Brenta vicino ai laghi di **Garda, Molveno e Tenno** e adiacente alle terme di **Comano**.

Il Master è rivolto a trader meccanici (o aspiranti tali) e professionisti. Un corso approfondito di analisi quantitativa con due docenti d'eccezione: **Enrico Malverti**, trader e responsabile del team di analisi quantitativa di **P&C Sim**, e **Francesco Caprifoglio**, Portfolio e Risk Management Analyst di **P&C Sim**.

La programma prevede un giorno dedicato a costruire un Trading System partendo da zero ed illustrando tutti i procedimenti per renderlo stabile e robusto ed un giorno di trading in tempo reale a mercati aperti per esplorare in maniera pratica e chiara le diverse metodologie operative e la gestione del rischio di un portafoglio automatizzato di trading.



Sabato 29 maggio:

- Dalle ore 10 alle ore 12: arrivi, check in e sistemazione nelle camere.
- Ore 12: consegna delle dispense per una prima presa di contatto con gli argomenti del corso
- Ore 12.15: pranzo
- Ore 14.00 Pomeriggio Relax: dopo l'arrivo ci si può rilassare scegliendo tra varie opportunità:
 - Trattamento benessere (incluso nel prezzo);
 - Escursioni sulle splendide montagne trentine;
 - Passeggiate sul lago (lago di Tenno a 12 km, Riva del Garda a 25 km)
 - Golf Club Rendena (a circa 30 km dall'hotel)
 - Visita al parco termale delle terme di Comano
- Ore 18.00 Introduzione ai Trading System e al Trading Quantitativo
- Ore 19.30 Cena

Domenica 30 maggio:

Ore 9.00/12.30 e 14.15/18.15 – Corso Day 1:

(SVILUPPO E TESTING DI UN TRADING SYSTEM su Euro-dollaro)

- Conoscere il mercato
- Analisi della serie storica. Ricercare la volatilità
- Testing preliminare dei pattern e degli oscillatori
- Selezione e codifica della tecnica d'ingresso
- Le uscite: la gestione del rischio
- Analisi del MAE e MFE, Time At Market e Risk Reward Ratio
- I parametri da rispettare
- Individuare aree di lavoro per migliorare il TS
- Test dei filtri operativi
- Effetto stagionalità sul Trading di breve termine
- Significatività e robustezza
- Ottimizzazione e sovraottimizzazione: analisi in 3D per trovare le aree di stabilità
- L'aiuto dei software: Montecarlo Simulation e attendibilità statistica del Drawdown
- L'ultimo step: il Money Management
- Walk Forward Analysis
- Export dei dati sensibili e analisi con Excel

Ore 19.30: Cena

Lunedì 31 maggio:

Ore 9.00/12.30 e 14.30/18.00 - Corso day 2:

(TRADING A MERCATI APERTI con Enrico Malverti e Massimiliano Del Corona):

- Trading Multimarket Multisystem Multitime frame intraday su futures
- Spread trading su Azioni, Valute e Commodities
- Assemblare un portafoglio diversificato
- Dipendenza e Trading sull'equity curve
- Un'amica per il Trader sistematico: la volatilità
- Principi di normalizzazione
- Analisi delle correlazioni tra i mercati e correlazioni tra i Trading System
- Analisi del VAR
- Il problema del flusso dati
- Come limitare lo Slippage
- Dal trading manuale al trading automatico: operare senza emotività
- Gestione di una Postazione Automatizzata

Ore 18.00: Conclusione dei lavori



Prezzo: ~~1500~~€ compreso trattamento di pensione completa in camera standard + trattamento benessere. **Prezzo scontato 1260 € per chi si iscrive entro il 31/03/2010** con versamento anticipato del 30% del costo.

La chiusura delle iscrizioni avverrà il **10/04/2010**. Il corso si effettuerà con un numero minimo di 3 iscritti e massimo di 14. Gli accompagnatori potranno partecipare al costo di 300 € in trattamento di pensione completa + trattamento benessere.



Per info e iscrizioni: Private & Consulting Group Tel. +39 011 535739, Fax: +39 011 5578384 5406, email: info@privateconsulting.net

***Enrico Malverti**: è responsabile team di consulenza di **Private & Consulting Sim Spa**. Private & Consulting Sim è advisor del fondo “Europe Market Neutral” di Lemanik Sicav. Enrico Malverti progetta sistemi di trading e di gestione del rischio automatizzati per clienti istituzionali su azioni, fondi, valute e futures. E' autore di numerose pubblicazioni su trading system e money management per Franco Angeli, Experta, Tradinglibrary, Il Sole 24 Ore.

****Francesco Caprioglio**: Analista quantitativo del team di consulenza di **Private & Consuting Sim Spa** per cui si occupa di analisi di portafoglio e risk management. Ha lavorato a Londra per **ABN AMRO, RBS Group** occupandosi della creazione di strumenti strutturati.



LINK UTILI

<http://www.comano.to/ita/home/home.php?where=home>

<http://www.golfrendena.it/>

<http://www.termecomano.it/>



Come arrivare: **Hotel Villa Del Campo, Campo Lomaso (Comano Terme)**

