



## RCM Trust Trading Programme

Il programma di trading RCM Trust è al 100% applicato al mondo reale del trading di strumenti finanziari, in particolare di quelli caratterizzati da buona liquidità. Questo programma è stato specificamente disegnato per equipaggiare ogni partecipante con le capacità pratiche e le conoscenze teoriche necessarie per competere con successo nell'arena globale del trading di futures.

I partecipanti avranno l'opportunità di sviluppare e dimostrare la loro comprensione delle più avanzate ed efficaci applicazioni al trading, così che al completamento del programma ognuno dovrebbe aver acquisito un ampio range di capacità preziose per lavorare sui mercati finanziari: dal settaggio e utilizzo di hardware e software alla costruzione e gestione di un reale portafoglio di mercato. Più in dettaglio:

Come usare software di valutazione statistica e grafica per analisi finanziarie e decisioni di trading.

Come usare metodi quantitativi standard e proprietari per calcolare le regole di money management in ogni mercato.

Come usare piattaforme di trading di ultima generazione per operare in tempo reale sui mercati finanziari, in ogni frequenza temporale e con strumenti molto liquidi.

Come costruire e gestire un portafoglio futures che include tutte le asset classes.

Di seguito modalità e contenuti del programma in oggetto.

**Modalità:** on site e/o on line via conference call.

**Date & ore:** il programma è estremamente flessibile, può variare da seminari di un giorno, o 7 ore, fino a 10 mesi, o 100 ore.

## Modulo Base

### Agenda

#### **Argomenti:**

Analisi degli sviluppi in atto sui principali mercati finanziari

Le principali funzioni di Metastock Professional, (programma di analisi grafica)

I mercati finanziari come sistemi adattivi complessi, cenni.

Teoria delle probabilità e giochi a somma zero, cenni.

Ottimizzazioni dinamiche come base di analisi per la costruzione di una strategia di investimento.

Prodotti finanziari: azioni, futures, opzioni. Cosa sono e come si usano. Funzione attuale e storica dei derivati all'interno del sistema finanziario, cenni.

Analisi di:

Revisione delle aspettative

Principali dinamiche di mercato

Conferme del ciclo in essere

Punti di svolta dei cicli

Money management

Unicità del trigger

Strategie di investimento standard utilizzate dai gestori di Hedge Funds. Cenni.

RCM Trust Vs Top 5 Hedge Funds: struttura, metodologie, comparazione della performance.

## Modulo Avanzato

### Agenda

#### **Argomenti:**

- Analisi periodica degli sviluppi in atto sui principali mercati finanziari.
- Definizione di: ammontare di capitale gestibile, efficienza del trading, rischio, rendimento, target&stop statici, target&stop dinamici, Runner. Esercizi con fogli di calcolo RCM Trust
- Metodi quantitativi standard e proprietari per calcolare le regole di money management, ossia tutti i parametri utili per la definizione di un efficiente risk-reward ratio. Applicazione sui mercati della metodologia tramite esercizi con fogli di calcolo RCM Trust.
- Metodi quantitativi standard e proprietari per testare i filtri, ossia tutte le nuances utili a selezionare le condizioni di mercato con maggiore probabilità di verificarsi. Applicazione sui mercati della metodologia tramite esercizi con fogli di calcolo RCM Trust.
- Utilizzo di SPSS per analisi statistiche.
- Analisi delle performance di portafoglio:

La media.

La moda.

La mediana.

La deviazione standard.

La distribuzione di probabilità normale.

La skewness.

La kurtosis.

Il boxplot :una dispersione della distribuzione più sofisticata rispetto al range base, il range interquatile.

Jensen's alpha.

Beta.

Sharpe ratio.

## **Gestione di portafoglio:**

Struttura di portafoglio: definizione dell'ammontare gestito, modello fisso di risk-reward, modello variabile di risk-reward, pesi, diversificazione.

La gestione avverrà seguendo il servizio RCM Trust 'Morning Calls Pro'.

Questo progetto certifica una gestione di portafoglio simulata, dove tutte le transazioni riguardanti il portafoglio stesso sono gestite da una piattaforma di trading di ultima generazione e registrate nei report di Audit ufficiali di una tra le maggiori case di brokeraggio internazionale.

I partecipanti avranno accesso e gestiranno un portafoglio di 2.000.000 USD in tempo reale analizzando barre di prezzo giornaliere Open-High-Low-Close (OHLC). Il portafoglio è composto da due conti simulati di trading, ognuno di 1.000.000 USD.

Il modello RCM Trust viene testato su 12 mercati futures elettronici Statunitensi.

Il conto DU 36207 è dedicato a: Mini DJIA, Mini S&P 500, Mini Nasdaq 100, Mini Russel 2000, 10 Year US Treasury Notes, EUR/USD Futures.

Il conto DU 36208 è dedicato a: Mini Sweet Crude, Mini Natural Gas, Gold 100 Troy oz, Wheat, Corn, Soybeans.

Dato che questo modulo si svilupperà seguendo il servizio RCM Trust 'Morning Calls Pro', potrà anche accadere di partecipare alla gestione live del portafoglio RCM Trust.

Inoltre la gestione di portafoglio include anche:

- 5 sessioni di trading live su mercati futures USA.
- Esecuzione di trades in real time.
- Utilizzo di una piattaforma di trading di ultima generazione.
- Trading automatico.
- Caratteristiche, pro&contro degli ordini di tipo market, limit, stop e derivazioni di questi.

Ogni sessione live inizierà alle 15:30 e terminerà alle 21:30 CET. Il numero delle sessioni live potrà essere aumentato secondo le esigenze dei partecipanti.

(l'ordine di trattazione potrà adattarsi allo sviluppo del corso)

Il costo del programma è funzione del periodo e degli argomenti trattati.

È data facoltà di recedere dal presente programma per mezzo di raccomandata A.R. da spedire all'indirizzo di residenza del Sig... La volontà di recesso deve essere comunicata con un preavviso non inferiore ad un mese, 30 giorni. Il recesso non avrà effetto per le prestazioni già eseguite, per cui non vi diritto a rimborsi per le somme già versate.

RCM Trust.