

Le Formule Essenziali per la Gestione del Rischio

La matematica che ti tiene in vita nei mercati. I calcoli che il tuo cervello emotivo si rifiuta di fare.

Benvenuto nel tuo Laboratorio di Trasformazione!

Questo strumento fa parte del **KIT MINDSET DEL TRADER DISCIPLINATO**, una collezione di risorse pratiche progettate per aiutarti a implementare i principi del libro **"La Disciplina del Trader"**. Ogni foglio di lavoro è stato creato per essere un'arma precisa contro i demoni mentali e un mattone per costruire la tua fortezza psicologica.

Usalo con costanza: la disciplina non è un'opzione, è un sistema.

Perché Queste Formule Sono il Tuo Pilastro

I trader dilettanti si concentrano sui profitti. I professionisti si ossessionano con il rischio. La differenza tra chi sopravvive e chi viene spazzato via non sta nella capacità di predire il futuro, ma nella gestione matematica del presente.

Questo foglio non contiene "teorie", ma le tre formule fondamentali che costituiscono il pilastro di ogni operatività sostenibile. Ignorarle non è un'opzione: è una garanzia di fallimento. Padroneggiarle significa costruire una corazza matematica contro l'emotività e la casualità.

Come Utilizzarlo: La Regola del "Prima il Rischio"

- ✓ Stampa questo foglio e tienilo vicino alla tua postazione.
- ✓ Usa la Formula #1 PRIMA di ogni singola operazione, senza eccezioni. La dimensione della posizione è la decisione di rischio più importante che prenderai.
- ✓ Controlla la Formula #3 ogni volta che hai più di due posizioni aperte per assicurarti di non essere inconsapevolmente sovraesposto.

FORMULA #1: IL DIMENSIONAMENTO CORRETTO DELLA POSIZIONE (in 30 secondi)

Il calcolo che determina il 73% del tuo successo.

Il Principio: Non decidi tu "quante azioni comprare". Lo decide la matematica, basandosi su quanto sei disposto a perdere.

LA FORMULA

$(\text{Capitale Totale} * \% \text{ di Rischio per Operazione}) / (\text{Prezzo di Ingresso} - \text{Prezzo di Stop Loss})$

ESEMPIO PRATICO:

- Capitale Totale: 10.000€
- % di Rischio per Operazione (la tua regola non negoziabile): 1% (cioè 100€)
- Prezzo di Ingresso del Titolo: 50,00€
- Prezzo di Stop Loss: 48,00€
- Rischio per Azione: $50,00€ - 48,00€ = 2,00€$

Calcolo della Dimensione:

$(10.000€ * 0,01) / 2,00€ = 100€ / 2,00€ = 50 \text{ Azioni}$

Azione: Puoi comprare un massimo di 50 azioni di quel titolo, non una di più. Questa non è un'opinione, è matematica.

FORMULA #2: IL KELLY CRITERION SEMPLIFICATO (per trader avanzati)***Il calcolo per ottimizzare il rischio nel lungo periodo.***

Il Principio: La percentuale ottimale di capitale da rischiare dipende non solo dal rapporto rischio/rendimento, ma anche dalla tua percentuale storica di successo.

LA FORMULA

$$\% \text{ da Rischiare} = \% \text{ Vincita} - [(1 - \% \text{ Vincita}) / \text{Rapporto Medio Profitto/Perdita}]$$

ESEMPIO PRATICO:

- Percentuale Storica di Vincita (dai tuoi dati): 55% (0.55)
- Rapporto Medio Profitto/Perdita (dai tuoi dati): 2:1 (cioè 2)

Calcolo della % da Rischiare:

$$0.55 - [(1 - 0.55) / 2] = 0.55 - [0.45 / 2] = 0.55 - 0.225 = 0.325 \text{ (cioè 32.5\%)}$$

ATTENZIONE - ADEGUAMENTO PER LA REALTÀ:

Il Kelly Criterion puro è estremamente aggressivo. I professionisti usano tipicamente una frazione (dal 25% al 50%) del risultato.

- Kelly Frazionato al 25%: $32.5\% \times 0.25 = 8.125\%$ di rischio per operazione.

FORMULA #3: IL "CALORE" DEL PORTAFOGLIO (Il tuo livello di rischio totale)

Il controllo che ti salva dai disastri causati da correlazione nascosta.

Il Principio: Il rischio totale non è la somma delle singole posizioni, ma l'impatto combinato di una serie di eventi negativi.

IL CALCOLO (da fare in 60 secondi):

1. Per ogni posizione aperta, calcola il **rischio monetario (Prezzo Ingresso - Prezzo Stop) * Numero Azioni**.
2. Somma tutti i rischi monetari delle tue posizioni aperte.
3. Dividi la somma per il tuo Capitale Totale e moltiplica per 100.

ESEMPIO PRATICO: Capitale Totale: 25.000€

- Posizione 1 (Apple): Rischio di 250€
- Posizione 2 (Oro): Rischio di 200€
- Posizione 3 (Euro/Dollaro): Rischio di 300€

Calcolo della Dimensione:

Rischio Totale Aperto: $250€ + 200€ + 300€ = 750€$

Percentuale di "Calore": $(750€ / 25.000€) * 100 = 3\%$

Azione: Puoi comprare un massimo di 50 azioni di quel titolo, non una di più. Questa non è un'opinione, è matematica.

REGOLA DI SICUREZZA:

- "Calore" < 6%: Zona Verde (Gestione normale).
- "Calore" 6-10%: Zona Gialla (Allerta. Non aprire nuove posizioni).
- "Calore" > 10%: Zona Rossa (Pericolo. Inizia a ridurre l'esposizione).

Impegno Personale: *Mi impegno a fidarmi della matematica più che delle mie "sensazioni". Il rischio è l'unica variabile che posso veramente controllare.*

Firma: _____ **Data:** _____

Spero che questo strumento ti sia di grande aiuto. Ricorda, ogni singolo foglio di questo Arsenale è un mattone per costruire non solo la tua disciplina, ma la tua libertà.

Al tuo successo,

Lysanna De Carlo