

# DSS TRADING SYSTEM

## Roadmap Migliorie Future

Stato Attuale	PF 1.19   WR 60%   Return +8.2% (1Y backtest)
Configurazione	MAX_HOLD 8 sett.   Trailing 6%/3.5%/1.5%   Risk 1.5% compound
Broker	Trade Republic (LS Exchange)
Dati	Polygon.io Starter
Data	Febbraio 2026   Versione 1.0

### Panoramica

Questo documento definisce la roadmap di evoluzione del sistema DSS, organizzata in 4 fasi progressive. Ogni fase ha prerequisiti chiari: non si procede alla successiva finche la precedente non e completata e validata con dati reali. Il principio guida e 'dati prima delle opinioni'.

Fase	Periodo	Costo/mese	Impatto
1 - Validazione Live	0-6 mesi	0 EUR	Conferma edge (fondamentale)
2 - Ottimizzazione	6-12 mesi	0 EUR	Riduzione drawdown, miglior selezione
3 - Automazione	12-18 mesi	30-50 EUR	Zero errori umani, meno slippage
4 - Espansione	18+ mesi	100-300 EUR	Piu strategie, Sharpe migliore

# FASE 1 — Validazione Live (Mesi 0-6)

**Obiettivo:** Confermare che il backtest predice la realtà. **Costo:** 0 EUR | **Tempo:** 15-20 min/giorno (già previsto)

## 1.1 Operare il sistema senza modifiche

Il dato più prezioso che puoi ottenere nei primi 6 mesi è la risposta alla domanda: "il backtest è affidabile?". Ogni modifica fatta prima di avere questa risposta è prematura.

- Seguire rigorosamente la Guida Operativa Trade Republic
- Registrare ogni trade in un journal: data entry, prezzo, data exit, prezzo exit, motivo exit, P&L
- NON modificare parametri, NON aggiungere strategie, NON cambiare nulla

## 1.2 Confronto Live vs Backtest

Dopo 3 e 6 mesi, confrontare le metriche chiave:

Metrica	Backtest	Live 3M	Live 6M
Win Rate	60%	?	?
Profit Factor	1.19	?	?
Avg R per trade	+0.08	?	?
Max Drawdown	9-10%	?	?

**Interpretazione:**

- **PF live > 1.0** — sistema profittevole, procedere con Fase 2
- **PF live 0.85-1.0** — edge marginale, analizzare se slippage/timing sono il problema
- **PF live < 0.85** — edge non confermato, fermarsi e analizzare prima di continuare

## 1.3 Documentare le discrepanze

Ogni differenza tra backtest e live va documentata:

- Slippage reale vs stimato (0.2%)
- Ordini non eseguiti (gap, liquidità insufficiente)
- Errori operativi (ordine sbagliato, timing errato)
- Differenze di prezzo LS Exchange vs dati Polygon.io

# FASE 2 — Ottimizzazione Robusta (Mesi 6-12)

**Obiettivo:** Rendere il sistema piu robusto senza cambiarne la natura. **Costo:** 0 EUR | **Tempo:** 10-20 ore totali di sviluppo

## 2.1 Walk-Forward Validation

Invece di ottimizzare su tutto lo storico (rischio overfitting), implementare un processo rolling:

- 1. Ottimizzare parametri su 12 mesi di dati (in-sample)
- 2. Testare sui 3 mesi successivi (out-of-sample) senza modifiche
- 3. Spostare la finestra avanti di 3 mesi e ripetere

Se i parametri reggono su tutte le finestre, l'edge e strutturale. Se funzionano solo su certi periodi, c'e overfitting e serve semplificazione.

## 2.2 Regime Filter

Aggiungere un filtro che riduce l'esposizione in condizioni di mercato sfavorevoli. I drawdown piu grandi avvengono quasi sempre quando il mercato complessivo scende.

Indicatore	Condizione	Azione
S&P; 500 vs SMA 200	Sotto SMA 200	Max 2 slot (invece di 3)
VIX	> 30	Max 1 slot o stop trading
Market Breadth	< 40% sopra SMA 50	Ridurre esposizione

**Vantaggio atteso:** ridurre il Max Drawdown (ora 9-18%) senza sacrificare troppo rendimento.

## 2.3 Integrare il Composite Scoring

Il sistema di scoring a 100 punti in scoring.py esiste gia ma viene ignorato dal portfolio manager. Collegare il ranking effettivo al composite score per migliorare la selezione dei trade. Rischio basso: e codice gia scritto, solo da integrare e validare con backtest.

## FASE 3 — Automazione (Mesi 12-18)

**Obiettivo:** Eliminare l'esecuzione manuale e l'errore umano. **Costo:** 30-50 EUR/mese | **Tempo:** 30-50 ore sviluppo iniziale

### 3.1 Migrazione a Interactive Brokers

Trade Republic è ottimo per iniziare ma non ha API per trading automatico. Interactive Brokers offre accesso diretto a NYSE/NASDAQ, ordini avanzati, e API complete.

Feature	Trade Republic	Interactive Brokers
API trading	No	Si (TWS API / ib_insync)
Commissioni US	1 EUR/ordine	~0.005\$/share (~1-2\$/trade)
Accesso diretto NYSE	No (via LS Exchange)	Si
Slippage stimato	0.10-0.50%	0.02-0.10%
Costo mensile	0 EUR	~10 EUR (azzerabile)

**! Nota fiscale:** IB non è sostituto d'imposta in Italia = regime dichiarativo. Serve commercialista (~200-400 EUR/anno). Valutare se il risparmio su slippage compensa.

### 3.2 VPS (Virtual Private Server)

Un server cloud (Hetzner, DigitalOcean, AWS Lightsail: 5-15 EUR/mese) che esegue il sistema 24/7. Cron job per: lunedì sera (analisi), martedì mattina (ordini), mercoledì-giovedì (monitoraggio), venerdì (exit rules). Il sistema opera anche quando sei in vacanza.

### 3.3 Sistema di Notifiche

- **Telegram Bot** (gratuito): push per ogni trade aperto/chiuso, alert su drawdown
- **Email giornaliera:** riepilogo posizioni, P&L, segnali per domani
- **Alert critici:** se drawdown supera soglia (es. -12%), notifica immediata

# FASE 4 — Espansione (Mesi 18+)

**Obiettivo:** Aumentare rendimento e diversificazione. **Costo:** 100-300 EUR/mese | **Tempo:** investimento continuo

## 4.1 Espansione Universo di Titoli

Aggiungere mercati europei (DAX, FTSE 100, CAC 40, AEX) ed ETF settoriali US (XLK, XLF, XLE). Più candidati = migliore selezione, perché prendi solo i 3 migliori tra un pool più ampio. La logica resta identica, cambiano solo ticker, fusi orari e valute.

## 4.2 Strategie Aggiuntive Non Correlate

Ogni strategia indipendente con edge positivo migliora lo Sharpe ratio complessivo, anche se individualmente mediocre.

Strategia	Logica	Correlazione con DSS
Earnings Momentum	Long dopo earning surprise positiva	Bassa (event-driven)
Mean Reversion	Short-term reversal su RSI estremi	Bassa (contrarian)
Stagionalità	Pattern ricorrenti (es. Santa Rally)	Molto bassa (calendar)
Pairs Trading	Long/short su coppie correlate	Quasi zero (market-neutral)
Breakout Volumi	Entry su rottura range + volume anomalo	Media (diverso trigger)

## 4.3 Dati Alternativi

Tipo dato	Fonte	Costo	Uso
Fondamentali	Tiingo / Quandl	30-50 EUR/m	Filtro qualità azienda
Short Interest	FINRA / Ortex	50-100 EUR/m	Identificare short squeeze
Insider Trading	SEC EDGAR	0 EUR	Confidenza management
Flussi istituzionali	WhaleWisdom	30 EUR/m	Seguire smart money
Sentiment	StockTwits / NewsAPI	0-50 EUR/m	Filtro sentiment estremo

## 4.4 Machine Learning per Ranking

Con 12-18 mesi di dati storici (segnali + risultati), allenare un modello che impara quali features predicono i trade migliori. NON per generare segnali (troppo overfitting) ma per filtrare e prioritizzare quelli esistenti. Modelli consigliati: Random Forest o Gradient Boosting (interpretabili, robusti). Validazione rigorosamente out-of-sample.

# PRINCIPI GUIDA

## **1. Non ottimizzare prematuramente.**

Ogni modifica deve essere giustificata dai dati, non dall'intuizione.

## **2. I dati reali battono sempre la teoria.**

Se il live trading dice qualcosa di diverso dal backtest, credi al live.

## **3. Semplicità > Complessità.**

Un sistema semplice che capisci bene batte un sistema complesso che non capisci.

## **4. Il compound fa il lavoro pesante.**

Con PF 1.19 e reinvestimento, il tempo è il tuo alleato più forte. Non serve cercare rendimenti spettacolari.

## **5. La disciplina è il vero edge.**

Il mercato è pieno di sistemi che funzionano sulla carta. La differenza la fa chi li esegue con costanza, mese dopo mese, anche quando il drawdown fa male.

---

*Documento generato come riferimento strategico. Da aggiornare ogni 6 mesi con i risultati reali del live trading.*