BOOTCAMP QUANTASTE · SERATA 1 DI 3

Il workbook *della serata*

I prompt usati in diretta, copiati parola per parola, e il codice già pronto. Rifai tutto il percorso sull'oro, poi sul tuo mercato.

Lunedì 16 novembre · ore 20:30

Cosa ti serve

File	Cos'è
I dati dell'oro al minuto scaricali da Google Drive	Vent'anni di oro (GC), una riga per minuto, dal 2006 a oggi, senza buchi
Questo workbook	I 5 prompt della diretta, in ordine, con i numeri che devono uscire
BF26_Oro_Base.pine	La strategia per TradingView, già provata
BF26_Oro_Base_MultiCharts.txt	La stessa strategia per MultiCharts e TradeStation
Natura_oro_GC.html	La «natura» dell'oro vista in diretta: si apre con Chrome

Più un'AI che legga un file e faccia calcoli (in diretta abbiamo usato Claude) e un account gratuito di TradingView.

PRIMA DI COMINCIARE

I dati: *cosa c'è dentro*

Vent'anni di oro, una riga per ogni minuto. Prima di chiedere qualcosa all'AI, sappi cosa le stai dando.

Le colonne

```
"Date","Time","Open","High","Low","Close","TotalVolume"
02/01/2006,19:01:00,1371.3,1371.3,1370.9,1370.9,24
```

Date giorno/mese/anno · **Time** ora di New York · **Open, High, Low, Close** apertura, massimo, minimo e chiusura del minuto, in dollari per oncia · **TotalVolume** contratti scambiati.

Tre cose da sapere

1. L'ora è quella di New York e segna la fine del minuto. «17:00:00» è l'ultimo minuto della giornata, non il primo del giorno dopo.

2. La giornata del future va dalle 18:00 alle 17:00 di New York, cioè dalle 0:00 alle 23:00 italiane. Per questo il primo prompt sposta le barre della sera al giorno dopo.

3. I prezzi sono «rettificati». I contratti in scadenza sono cuciti uno dopo l'altro togliendo il salto: nel 2006 leggi circa 1.371 invece di circa 550. I dollari guadagnati per operazione restano giusti, le percentuali no.

Come si parte

1. Scarica i dati dal **link di Google Drive**.
2. Apri **claude.ai** in una **chat nuova** e allega il file.
3. Incolla il prompt 1 così com'è. Aspetta la risposta, poi il 2, e così via, **sempre nella stessa chat**.
4. Confronta i numeri con «cosa deve uscire». Se sono lontani, chiedi all'AI di ricontrollare quel passo.

PROMPT 1 E 2

Dai minuti alle barre, *poi la prova*

PROMPT 1 Le barre da 15 minuti e le giornate

```
Analizza questo export csv, Trasforma i dati al minuto in barre da 15 minuti. Aggiungi una colonna
"giorno" con la giornata del future: le barre che finiscono dopo le 17:00 di New York appartengono al
giorno dopo.
Poi calcola per ogni giornata apertura, massimo, minimo e chiusura.
```

Cosa deve uscire: circa 489.000 barre da 15 minuti, una giornata per ogni seduta dal 2006.

PROMPT 2 La prova: compro ogni rottura

```
Con le barre da 15 minuti fai questo backtest, 1 contratto, 100 $ a punto, senza costi. In ogni
giornata, sulle barre che aprono fra le 3:00 e le 15:45 di New York, prendi la prima rottura del
massimo o del minimo della giornata fin lì: compro con uno stop esattamente sul massimo, vendo con uno
stop esattamente sul minimo (se la barra apre già oltre, entro all'apertura). Esco alla chiusura
dell'ultima barra della giornata. Una sola operazione al giorno. Dammi numero di operazioni, guadagno
medio, netto, discesa massima, e il guadagno medio prima e dopo il 2018. Disegna l'equity line, e
anche quella di chi fa il contrario.
```

Cosa deve uscire, più o meno	Ogni rottura
Operazioni	circa 5.140
Guadagno medio	circa 93 $
Prima del 2018	circa 28 $: quasi niente
Discesa massima	circa –73.000 $
Chi fa il contrario	la stessa curva capovolta: perde

La rottura «nuda» guadagna poco, e quasi solo negli ultimi anni. Serve un filtro.

PROMPT 3 E 4

Se ieri era indecisa, *oggi la rottura paga*

PROMPT 3 Le rotture divise per com'era ieri

```
Prendi tutte le operazioni del passo 1 e dividile in 5 fasce secondo il corpo della candela di ieri (|chiusura − apertura| ÷ (massimo − minimo)): 0-20%, 20-40%, 40-60%, 60-80%, 80-100%. Per ogni fascia: numero di operazioni e guadagno medio. Fai un grafico a barre.
```

Corpo di ieri	Operazioni	Guadagno medio
0–20%	1.049	184 $
20–40%	1.187	164 $
40–60%	1.168	108 $
60–80%	1.149	-24 $
80–100%	575	-14 $

Più ieri è stata indecisa (corpo piccolo), più oggi la rottura rende. Sopra il 60% perde.

PROMPT 4 Quale soglia? Dal 10% al 100%

```
Rifai il backtest del passo 1 tenendo solo i giorni in cui il corpo di ieri è al massimo il 10%, 20%, 30%, 40%, 50%, 60%, 70%, 80%, 90% e 100% (100% = nessun filtro). Tabella con operazioni, guadagno medio, netto, discesa massima, netto ÷ discesa e anni positivi. Grafico del guadagno medio per soglia, e la curva dei guadagni con la soglia al 40% contro quella senza filtro.
```

Corpo di ieri al massimo	Operazioni	Medio	Netto	Discesa max
10%	516	174 $	89.900 $	−22.960 $
20%	1.049	184 $	192.790 $	−22.680 $
30%	1.614	216 $	348.980 $	−18.290 $
40%	**2.236**	**173 $**	**387.260 $**	**−24.590 $**
50%	2.833	153 $	433.130 $	−23.150 $
60%	3.404	151 $	512.990 $	−24.380 $
100% (nessun filtro)	5.128	93 $	477.160 $	−73.250 $

Il 40% non è il «migliore»: fra il 30% e il 60% i risultati si somigliano. Una regola che regge anche nei vicini è meno probabile che sia rumore.

PROMPT 5 · TRADINGVIEW

La regola *su TradingView*

PROMPT 5 In una chat nuova, senza allegati

```
Scrivimi una strategia per TradingView sull'oro grafico a 15 minuti.

La regola:
- guardo la sessione di ieri: è "indecisa" se la differenza fra chiusura e apertura è al massimo il
40% della differenza fra massimo e minimo
- se ieri era indecisa, oggi dalle 3:00 alle 15:45 (orario borsa) compro se il prezzo supera il
massimo di oggi e vendo se scende sotto il minimo di oggi, esattamente su quei livelli
- una sola operazione al giorno
- niente stop e niente target: chiudo alle 17:00 di New York, alla chiusura dell'ultima candela, non
all'apertura del giorno dopo

Fammi cambiare il 40% e gli orari dalle impostazioni, e disegna sul grafico il massimo e il minimo di
oggi.
```

Come si mette sul grafico

1. TradingView, simbolo **GC1!** (oro, COMEX), grafico a **15 minuti**.
2. In basso **Pine Editor** → **Crea nuovo** → incolla il codice → **Aggiungi al grafico**.
3. Apri lo **Strategy Tester**. Per avere tutto lo storico attiva il backtesting esteso.

Cosa deve uscire: circa 2.875 operazioni dal 2001 (circa 2.250 dal 2006), 52,6% vincenti. Se in alto a destra vedi «ozt», i dollari sono per oncia: moltiplica per 100.

Se il codice dell'AI non compila o i numeri sono lontani, usa quello già provato nella pagina dopo (è anche nel file **BF26_Oro_Base.pine**).

CODICE PRONTO · TRADINGVIEW

BF26 Oro Base *in Pine*

Copialo così com'è. Le prime tre impostazioni (corpo, finestra, chiusura) si cambiano dal pannello della strategia.

```
//@version=6
// BF26 Oro Base — COMEX:GC1! a 15 minuti — 15/11/2026
// Se ieri l'oro e' stato indeciso (corpo <= 40% del range), dalle 9:00 alle 21:45 italiane
// compro sopra il massimo di oggi o vendo sotto il minimo di oggi. Una operazione al giorno, chiudo la sera.
strategy("BF26 Oro Base", overlay = true, default_qty_type = strategy.fixed, default_qty_value = 1,
     process_orders_on_close = true, margin_long = 0, margin_short = 0)

corpoMax  = input.float(0.40, "Corpo massimo di ieri (quota del range)", step = 0.05)
finestra  = input.session("0300-1545", "Finestra d'ingresso (ora di New York)")
chiusura  = input.session("1645-1700", "Barra di chiusura (ora di New York)")

// la giornata e' la sessione del future: comincia alle 18:00 di New York
nuovoGiorno = timeframe.change("D")
var float oOggi = na
var float hOggi = na
var float lOggi = na
var float oIeri = na
var float hIeri = na
var float lIeri = na
var float cIeri = na
var bool entratoOggi = false
if nuovoGiorno
    oIeri := oOggi
    hIeri := hOggi
    lIeri := lOggi
    cIeri := close[1]
    oOggi := open
    hOggi := high
    lOggi := low
    entratoOggi := false
else
    hOggi := math.max(hOggi, high)
    lOggi := math.min(lOggi, low)

rangeIeri    = hIeri - lIeri
ieriIndecisa = rangeIeri > 0 and math.abs(cIeri - oIeri) <= corpoMax * rangeIeri
inFinestra   = not na(time(timeframe.period, finestra, "America/New_York"))
fineGiorno   = not na(time(timeframe.period, chiusura, "America/New_York"))

if strategy.position_size != 0
    entratoOggi := true
    strategy.cancel("Su")
    strategy.cancel("Giu")

if inFinestra and ieriIndecisa and not entratoOggi and strategy.position_size == 0
    strategy.entry("Su", strategy.long, stop = hOggi)
    strategy.entry("Giu", strategy.short, stop = lOggi)
else if strategy.position_size == 0
    strategy.cancel("Su")
    strategy.cancel("Giu")

if fineGiorno
    strategy.close_all(comment = "sera")

plot(hOggi, "Massimo di oggi", color.gray, style = plot.style_linebr)
plot(lOggi, "Minimo di oggi", color.gray, style = plot.style_linebr)
bgcolor(ieriIndecisa ? color.new(color.gray, 92) : na, title = "Ieri indecisa")
```

CODICE PRONTO · MULTICHARTS E TRADESTATION

La stessa regola *in 7 righe*

```
If Time > 300 and Time < 1545
and AbsValue(CloseS(1) - OpenS(1)) <= 0.40 * (HighS(1) - LowS(1))
and EntriesToday(Date) = 0 then begin
    Buy next bar at HighS(0) stop;
    SellShort next bar at LowS(0) stop;
end;
SetExitOnClose;
```

Come si mette sul grafico

1. Grafico **@GC a 15 minuti**, sessione **Default** (18:00–17:00 New York), fuso **Exchange**.
2. **PowerLanguage Editor** → File → New → Signal → incolla → compila con F3.
3. Sul grafico: Insert Study → Signal → la tua strategia.

Attenzione alla parentesi: **0.40 * (HighS(1) - LowS(1))**. Senza, la strategia non entra mai.

Cosa deve uscire (05/01/2006 - 13/11/2026, 1 contratto, senza costi)	
Operazioni	2.252
Trade medio	177 $
Netto	+398.170 $
Vincenti	52,5%
Discesa massima	−27.460 $

Tutti i numeri sono senza costi né slippage: con i costi il trade medio scende. Se regge davvero lo vediamo mercoledì.

LA NATURA DELL'ORO

Prima il mercato, *poi la regola*

Il file Natura_oro_GC.html è la pagina vista in diretta. Si apre con un doppio clic in Chrome e funziona anche senza internet.

Sezione	Cosa guardare	Cosa ha deciso
Trend o elastico	A ogni timeframe, quanti anni il prezzo prosegue e quanti torna indietro	Sotto l'ora l'oro è un «elastico»: la rottura nuda non basta
Volatilità	Quanto si muove la giornata media, anno per anno	Gli ultimi anni pesano di più nel backtest
Quando è vivo	Range e volume ora per ora	Si entra dalle 9:00 alle 21:45 italiane
Anno tipo	Stagionalità e bias di orario	Guardati e scartati: durano settimane o vanno in un verso solo

Il tuo compito per mercoledì

Rifai il prompt 2 sul **tuo** mercato, oppure cambia la soglia del 40% e guarda cosa succede. Scrivi in chat cosa ti esce: lo commentiamo insieme.

E ADESSO?

Hai fatto *metà del lavoro*

Stasera hai visto come nasce una regola. Prima di metterci un euro mancano i passi che la mettono alla prova.

1 · Studio del mercato
che animale è, quando è vivo · *fatto stasera*

2 · L'idea
dagli studi e dai dati, mai dal nulla · *fatto stasera*

3 · Codice e backtest
con l'AI, su TradingView e MultiCharts · *fatto stasera*

4 · Validazione
costi, dati mai visti, walk-forward, Monte Carlo · *mercoledì*

5 · Portafoglio
più strategie e più mercati insieme, il rischio di tutto il conto

6 · Automazione e controllo
la strategia gira da sola, tu controlli che si comporti come nel test

È il percorso che facciamo in Quant Trader Academy

Dodici settimane per costruire, validare e automatizzare le tue strategie, con strategie a codice aperto da studiare e una community di persone che lavorano allo stesso modo.

Ti aspettiamo mercoledì alle 20:30 per il passo 4. Intanto: **academy.quantaste.com**

Materiale a scopo esclusivamente formativo ed educativo. Non costituisce consulenza finanziaria, raccomandazione personalizzata o invito a investire. Backtest e risultati passati non garantiscono risultati futuri. Il trading di futures e strumenti a leva comporta rischi elevati, inclusa la perdita totale del capitale.