Regge? *Sette torture per una regola*

Lunedì abbiamo costruito una regola sull'oro. Stasera proviamo a romperla, con le stesse prove che usiamo prima di accendere un sistema. Tutto quello che vedi in diretta lo rifai da solo, un prompt alla volta.

Mercoledì 18 novembre · ore 20:30

Cosa ti serve

File	Cos'è
GC_15min_2006_2026.csv scaricalo da questa cartella Drive	L'oro a 15 minuti dal 2006, già con la giornata del future: 28 MB, si allega direttamente a Claude
Questo workbook	2 prompt per capire e disegnare la strategia, poi 9 prompt di tortura con i numeri che devono uscire e i grafici della diretta
BF26_Oro_Base.pine	La strategia di lunedì per TradingView: il codice da incollare nei prompt A e B
BF26_Oro_Finale.txt	La versione finale per MultiCharts, provata il 18/11

Un'AI che legga un file e faccia calcoli: in diretta usiamo Claude. Una chat nuova, il file allegato, i prompt in fila nella stessa chat.

Chi scrive regole è tanto. Chi le sa scartare è poco: stasera impari a scartare.

PRIMA DI TORTURARLA

Capirla e *vederla*

Prima di mettere sotto tortura una regola, devi averla chiara. Apri ChatGPT, incolla questo prompt e sotto il codice Pine Script della strategia (BF26_Oro_Base.pine o la versione finale).

PROMPT A Disegnami la strategia e fammela capire

```
Ti incollo sotto il codice Pine Script di una strategia di trading per TradingView. Non sono un
programmatore: prima di usarla voglio capirla davvero.
1. Spiegamela in italiano semplice, regola per regola: su che mercato e timeframe, quando entra e da
che parte, dove esce, cosa la tiene ferma. Se usi un termine tecnico, spiegalo.
2. Disegnamela: un grafico a candele di esempio (giornate inventate ma realistiche) dove si vedono la
giornata di ieri con il corpo piccolo evidenziato, il massimo e il minimo di oggi, i due ordini in
attesa, l'ingresso, lo stop e l'uscita la sera. Poi un secondo esempio di una giornata in cui NON
entra, con scritto perché.
3. Fammi uno schema a blocchi della logica: una domanda dopo l'altra, con le risposte sì / no, fino a
«compro», «vendo» o «sto fermo».
4. Elenca i numeri che sono stati scelti da qualcuno (soglie, orari, stop) e che andrebbero
verificati, e in 3 punti cosa può andare storto nella realtà: esecuzione, costi, gap, orari.
5. Chiudi con la regola in una frase sola, come la spiegheresti a un amico.

CODICE:
[incolla qui il codice Pine Script]
```

Cosa deve uscire. La regola spiegata a parole, due giornate disegnate (una in cui entra, una in cui sta ferma), lo schema sì / no e l'elenco dei numeri da verificare: soglia del corpo, orari, stop. Sono proprio quelli che stasera mettiamo sotto tortura.

L'INDICATORE DI LUNEDÌ

Da strategia *a strumento di lavoro*

Lo stesso codice, portato al livello dopo: un pannello che ti dice ogni mattina se si opera, i livelli già disegnati, le statistiche e gli alert. In diretta lo facciamo con ChatGPT.

PROMPT B L'indicatore avanzato

```
Ti incollo sotto il mio indicatore/strategia Pine Script v6 per l'oro (COMEX:GC1!, 15 minuti).
Non cambiare la logica di trading: deve restare identica, così il backtest non si muove.
Solo tre aggiornamenti di regola: soglia del corpo di ieri al 30% invece del 40%, ingresso 1 tick oltre il massimo o il minimo di oggi, stop di emergenza a 3.000 $ a contratto.
Poi portalo a un livello professionale, da trader che lo usa davvero ogni giorno:
1. PANNELLO in alto a destra: «Oggi si opera?» SÌ verde / NO grigio, corpo di ieri in % del range, livello d'acquisto e di vendita, stop in prezzo e in $, minuti alla fine della finestra d'ingresso (15:45 New York).
2. LIVELLI DISEGNATI: massimo e minimo di oggi che si allungano a destra, con l'etichetta del prezzo d'ingresso; per ogni trade un box verde o rosso dall'ingresso all'uscita, con il risultato in $ scritto sopra.
3. GIORNATE INDECISE: sfondo colorato sulle giornate che attivano la regola, ed etichetta «ieri indecisa 23%» sulla prima barra.
4. STATISTICHE LIVE nel pannello: numero di trade, % vincenti, trade medio, profit factor, ultimo trade, drawdown massimo.
5. ALERT pronti: giornata operabile, ingresso, uscita, con un messaggio leggibile tipo «ORO: long sopra 4.123,4 · stop 4.093,4».
6. INPUT in gruppi (Regola, Orari, Rischio, Grafica), con la scelta contratto pieno GC o micro MGC che ricalcola stop e statistiche.
Scrivi il codice completo, compilabile senza errori in Pine v6, commentato in italiano.

CODICE:
[incolla qui il codice Pine Script]
```

Se TradingView dà un errore di compilazione, incolla l'errore nella stessa chat: «correggi senza cambiare la logica». La logica di trading non deve cambiare: i numeri del backtest devono restare quelli di prima.

IL PUNTO DI PARTENZA

La regola di lunedì, *in una chat nuova*

Allega il file e incolla il primo prompt. Costruisce il backtest che useremo per tutte le torture.

PROMPT 0 Il backtest di partenza

```
Ti allego le barre da 15 minuti del future dell'oro (GC) dal 2006. Colonne: FineBarraNY (ora di New York
in cui finisce la barra), Giornata (la giornata del future, che va dalle 18:00 alle 17:00 di New York),
Apertura, Massimo, Minimo, Chiusura. 1 punto = 100 $.

Costruisci un backtest riutilizzabile di questa regola, 1 contratto, senza costi:
- ieri «indecisa»: |chiusura − apertura| della giornata di ieri al massimo il 40% di (massimo − minimo)
di ieri;
- oggi, sulle barre la cui barra precedente finisce dopo le 3:00 e prima delle 15:45 di New York: la
prima volta che il prezzo supera il massimo della giornata fin lì compro con uno stop esattamente su quel
massimo, la prima volta che scende sotto il minimo vendo con uno stop su quel minimo (se la barra apre
già oltre, entro all'apertura; se nella stessa barra li tocca tutti e due, vince il lato più vicino
all'apertura);
- una sola operazione al giorno, esco alla chiusura dell'ultima barra della giornata.
Dammi operazioni, guadagno medio, netto, discesa massima, netto ÷ discesa e anni positivi. Grafico
grande: l'equity line in blu e sotto, in rosso, la discesa dal massimo (sott'acqua), con segnati il punto
più basso e i due periodi più lunghi senza nuovi massimi. Tieni il codice: nei prossimi messaggi lo
mettiamo sotto tortura.
```

Cosa deve uscire, più o meno	Regola di lunedì
Operazioni	circa 2.236
Guadagno medio	173 $
Netto	+387.260 $
Discesa massima	−24.590 $
Netto ÷ discesa	15,7
Anni positivi	16 su 21

MultiCharts dà 2.252 operazioni e 177 $: i due motori contano poche giornate in modo diverso. Conta la forma, non l'ultima cifra.

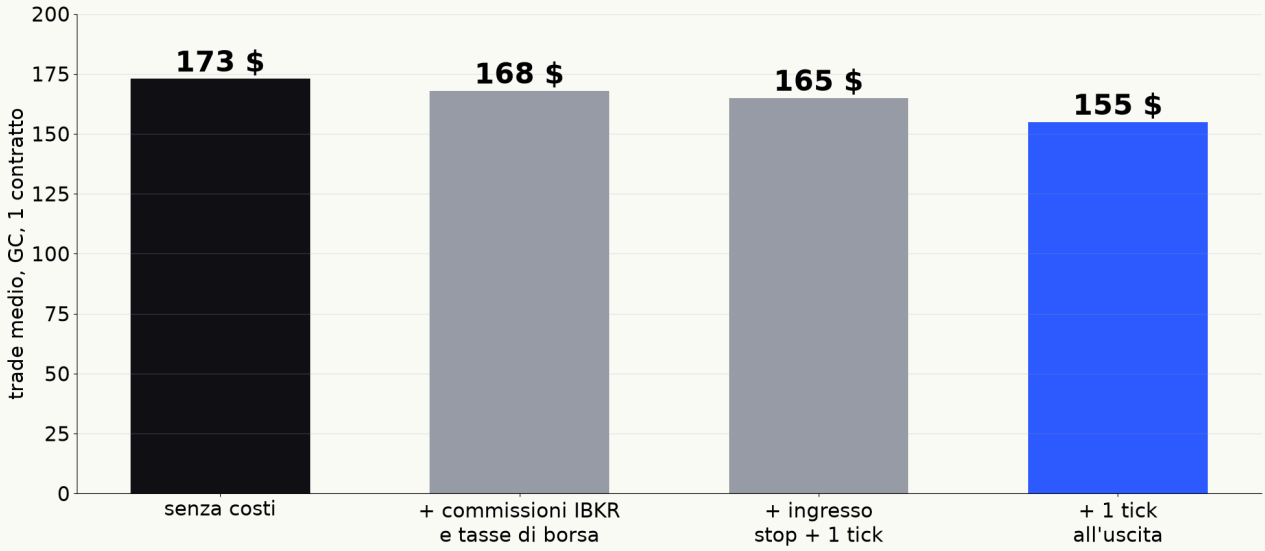
TORTURA 1

Con i costi veri *regge ancora?*

PROMPT 1 I costi

```
Tortura 1, i costi veri del broker. Rifai il backtest in quattro versioni, sempre 1 contratto GC:
1) senza costi;
2) con le commissioni di Interactive Brokers e le tasse di borsa: 2,35 $ a contratto per lato, cioè
4,70 $ a operazione;
3) come la 2, ma l'ordine stop entra solo se il prezzo supera il livello di 1 tick (0,1 punti = 10 $):
compro a massimo + 0,1, vendo a minimo − 0,1;
4) come la 3, più 1 tick di slittamento all'uscita (10 $).
Tabella con guadagno medio, netto, discesa massima, netto ÷ discesa e anni positivi. Poi rifai la
versione 4 per il micro MGC (10 once: dividi per 10, commissioni e tasse 1,50 $ a operazione, 1 tick =
1 $).
Grafici: le quattro equity line sovrapposte nello stesso grafico, con l'area fra la prima e l'ultima
colorata (è quello che ti mangia il broker), e un grafico a barre del guadagno medio.
```

GC, 1 contratto	Medio	Netto	Discesa max	Netto ÷ discesa	Anni +
1 · senza costi	173 $	+388.950 $	−24.590 $	15,8	16/21
2 · commissioni IBKR + tasse di borsa	168 $	+378.390 $	−24.880 $	15,2	16/21
3 · + ingresso stop + 1 tick	165 $	+371.100 $	−28.130 $	13,2	17/21
4 · + 1 tick all'uscita	**155 $**	**+348.640 $**	**−28.740 $**	**12,1**	**17/21**
4 · micro MGC (10 once)	14,5 $	+32.550 $	−2.960 $	11,0	16/21



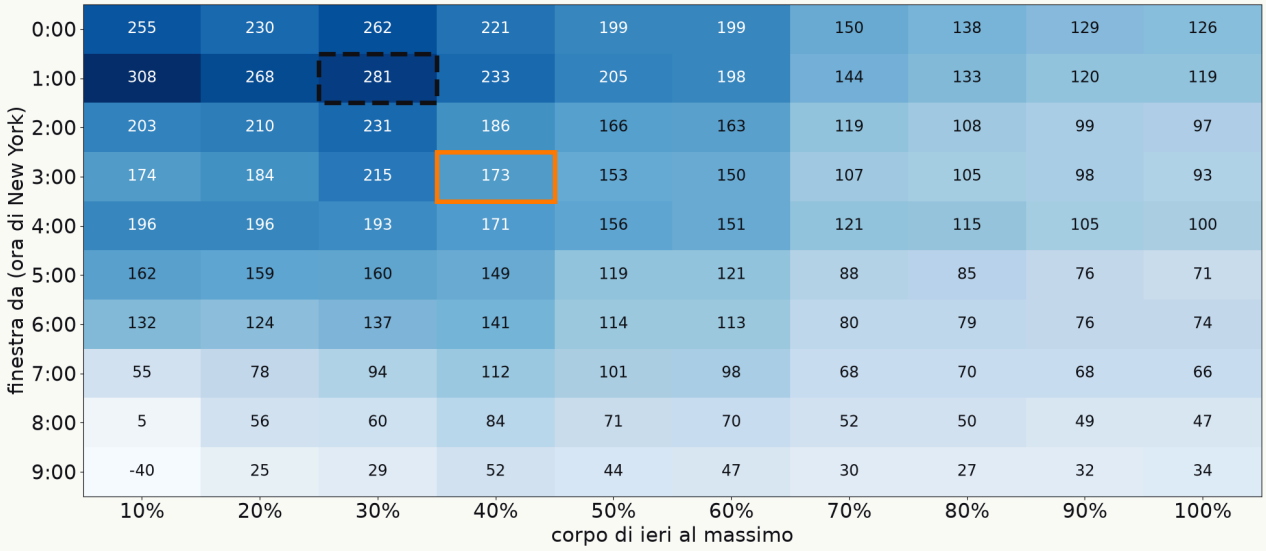
Cosa insegna. Con i costi veri del broker e un'esecuzione prudente la regola perde circa 18 $ a operazione su 173 $ e regge. Sul micro i costi pesano di più in proporzione, ma il conto da mettere in gioco è un decimo.

TORTURA 2

Ottimizzare male, *ottimizzare bene*

PROMPT 2 La griglia

```
Tortura 2, ottimizzare. Prova tutte le combinazioni: soglia del corpo di ieri dal 10% al 100% a passi
di 10, e inizio della finestra da mezzanotte alle 9:00 di New York ogni ora (la fine resta alle
15:45). Fammi due mappe di calore grandi, una del guadagno medio e una del netto ÷ discesa, con il
numero scritto in ogni casella, la casella migliore cerchiata e la regola di lunedì (3:00, 40%)
evidenziata in un altro colore. Poi crea un artifact interattivo: la mappa di calore cliccabile, e
cliccando una casella compare la sua equity line accanto a quella della regola di lunedì. Dimmi qual è
la casella migliore, e se le caselle intorno sono simili o crollano.
```



Così NON si fa

La casella più bella per netto ÷ discesa è **dall'1:00 con soglia 30%**: 281 $ a operazione e 26,6. «Mettila live, è bellissima.» È innamorarsi del rumore.

Così sì

Tutta la zona fra **mezzanotte e le 4** e fra **20% e 60%** guadagna e si somiglia. La regola di lunedì (riquadro arancio, 173 $) sta in mezzo alla zona. Si rompe solo partendo dalle 8–9.

TORTURA 3

Dati mai visti *e walk forward*

PROMPT 3 Scelgo sul passato, provo sul futuro

```
Tortura 3, dati mai visti. Scegli soglia e ora d'inizio migliori guardando SOLO il 2006-2015
(criterio: netto ÷ discesa), poi provale senza cambiarle sul 2016-2026. Metti a confronto, nei due
periodi, la combinazione scelta, la regola al 40% dalle 3:00 e la rottura senza filtro (soglia 100%).
Grafico: le tre equity line con lo sfondo del 2006-2015 in grigio («qui si sceglie») e del 2016-2026
in azzurro («dati mai visti»), e una linea verticale dove cambia.
```

Guadagno medio	2006–2015 (si sceglie)	2016–2026 (mai visti)
Scelta sul passato: 4:00, 60%	121 $ · 10/10 anni	177 $ · 10/11 anni
Regola di lunedì: 3:00, 40%	84 $	246 $
Rottura senza filtro	32 $	148 $

PROMPT 3B Il walk forward

```
Ora il walk forward: dal 2011, alla fine di ogni anno scegli la soglia (dal 10% al 100%, inizio alle
3:00) con il guadagno medio più alto su tutti gli anni precedenti, e usala solo l'anno dopo. Tabella
anno per anno con la soglia scelta e il risultato, poi il totale contro la regola fissa al 40% negli
stessi anni. Grafico: le due equity line sovrapposte, con scritta sopra ogni anno la soglia scelta.
```

Cosa deve uscire: sceglie il 10% fino al 2014, poi sempre il 30%. Dal 2011 fa **266 $** a operazione contro **205 $** della regola fissa, con 12 anni positivi su 16 per tutte e due. Non peggiora.

Cosa insegna. Fuori campione la regola regge, e il filtro di lunedì batte la rottura nuda in tutti i periodi. Il nostro QTA Validatore la dà «promossa con riserva»: la riserva sono i due anni e mezzo sott'acqua del 2008–2011.

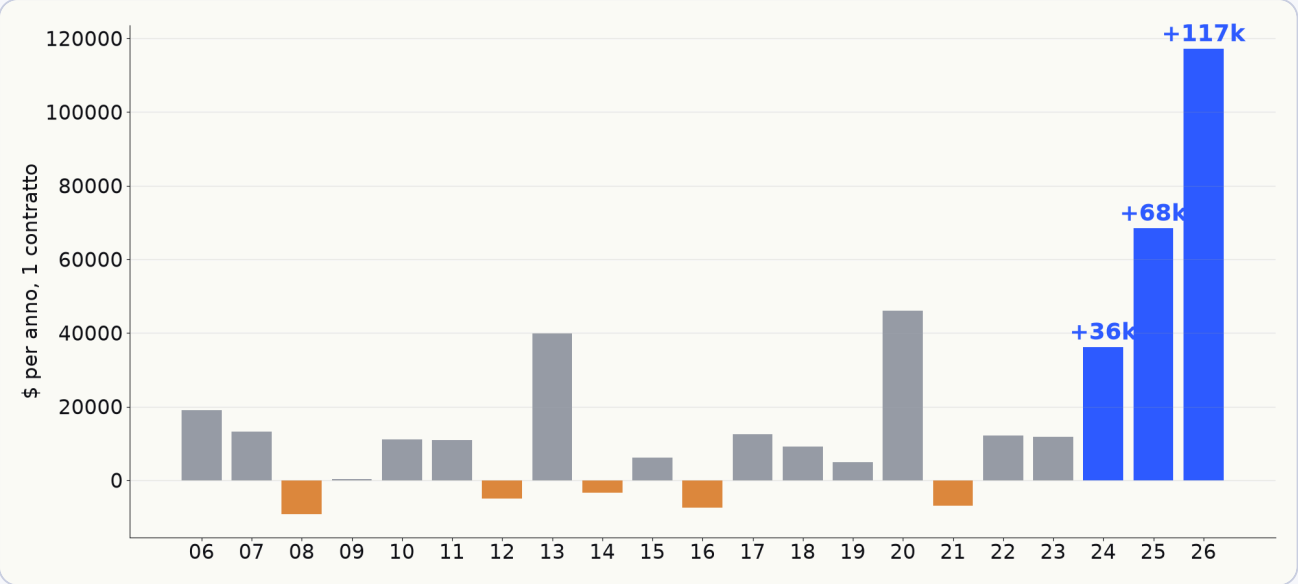
L'offerta del Bootcamp è aperta fino al 26/11

TORTURA 4

Dieci mesi bellissimi *non bastano*

PROMPT 4 Anno per anno

```
Tortura 4, gli anni. Guadagno per anno della regola al 40%, in un grafico a barre con gli anni 2024-2026 in un colore diverso e il loro totale scritto sopra. Che quota del netto totale viene dal 2024-2026? Rifai il conto in percentuale del prezzo d'ingresso, per togliere l'effetto dell'oro che è salito di prezzo, e metti i due grafici uno sopra l'altro: dollari e percentuale.
```



Cosa deve uscire: il **57%** del netto viene dal 2024–2026, il solo 2026 vale **+117.260 $** in 86 operazioni. In percentuale del prezzo il guadagno medio passa da 0,045% (2006–15) a 0,074% (2016–26): una parte è il prezzo dell'oro salito da 1.900 a 4.500 $, una parte sono anni davvero eccezionali.

Cosa insegna. Se avessi visto solo il 2026 l'avresti messa live domani. Lo dicono i vent'anni, e soprattutto quelli brutti, se una regola regge.

L'offerta del Bootcamp è aperta fino al 26/11

TORTURA 6

I filtri che *aggiungereste tutti*

PROMPT 5 La media mobile, in due modi

```
Tortura 6, i filtri. Aggiungi la media delle ultime 20 chiusure giornaliere, in due versioni:
A) se ieri la chiusura era sopra la media metto solo l'ordine di acquisto, se era sotto solo quello di vendita, e l'ordine resta attivo tutta la finestra;
B) metto tutti e due gli ordini come prima, ma se la prima rottura del giorno va contro la media quel giorno non faccio niente.
Confronta A, B e la regola senza filtro: operazioni, guadagno medio, netto, netto ÷ discesa. Grafico: le tre equity line sovrapposte, e accanto un grafico a barre del netto ÷ discesa con la regola senza filtro come linea di riferimento.
```

	Operazioni	Medio	Netto ÷ discesa
Senza filtro	2.236	173 $	15,7
A · ordine attivo tutto il giorno	~1.500	149 $ (MultiCharts 155 $)	9,0
B · la prima rottura decide	~1.090	207 $ (MultiCharts 211 $)	8,5

PROMPT 6 L'ADX

```
Prova anche l'ADX a 14 giorni di ieri: tengo solo i giorni con ADX sotto 20, 25, 30 e 40. Tabella con operazioni, guadagno medio e netto ÷ discesa. Grafico a barre del netto ÷ discesa per ogni soglia, con una linea orizzontale alla regola senza filtro. Il miglioramento regge se cambio di poco la soglia?
```

ADX 14 di ieri	sotto 20	sotto 25	sotto 30	sotto 40
Medio	176 $	174 $	175 $	153 $
Netto ÷ discesa	5,9	11,3	16,8	12,6

Cosa insegna. La stessa idea scritta in due modi dà 149 o 207 $: il codice dell'AI si legge riga per riga. E un filtro che migliora solo con un valore preciso (ADX sotto 30) e crolla un passo più in là non è un vantaggio: è rumore.

LA VERSIONE FINALE

La versione finale: *30% e lo stop di emergenza*

PROMPT 7 Soglia più stretta e uno stop di emergenza

```
La versione finale. Da qui in poi metti sempre i costi veri: 4,70 $ a giro di commissioni e tasse,
ingresso stop + 1 tick, 1 tick all'uscita. Cambia due cose alla regola:
1) la soglia del corpo di ieri: prova 20, 25, 30, 35 e 40% e dimmi se intorno al migliore i valori sono
simili o crollano;
2) uno stop di emergenza a 3.000 $ dal prezzo d'ingresso, controllato dalla barra dopo l'ingresso.
Confronta: regola di lunedì, soglia 30%, soglia 30% + stop. Poi prova lo stop a 2.000 e 4.000 $ e uno
stop in ATR (0,5 e 1 volta l'ATR delle ultime 20 giornate). Dimmi l'operazione peggiore di ogni versione.
Grafici: le equity line sovrapposte, e sotto la discesa (sott'acqua) di ognuna come area colorata, così
si vede dove lo stop salva il conto.
```

Con i costi veri	Lunedì (40%)	30%	30% + stop 3.000 $
Operazioni	2.246	1.614	1.614
Guadagno medio	155 $	198 $	193 $
Discesa massima	−28.737 $	−19.550 $	−17.528 $
Netto ÷ discesa	12,1	16,4	17,8
Anni positivi	17/21	15/21	16/21
Operazione peggiore	−16.255 $	−16.255 $	−3.015 $

Motore Python. In MultiCharts, stessi costi: lunedì 151 $ a operazione, netto ÷ discesa 12,5, peggiore −16.255 $; finale 171 $, 11,6, peggiore −3.125 $, 16 anni positivi su 21 contro 14. I due motori danno gli stessi trade dal 2015; prima cambia quali giornate contano come «indecise». Scartati: «ieri anche stretta» (con i costi scende a 9,3), media mobile (a 10 giorni sembra ottima, a 20 e 50 crolla), stop in ATR (da 17,8 a 12,7 cambiando di poco il moltiplicatore).

```
passo = MinMove / PriceScale;   { 1 tick }
If Time > 300 and Time < 1545
and AbsValue(CloseS(1) - OpenS(1)) <= 0.30 * (HighS(1) - LowS(1))
and EntriesToday(Date) = 0 then begin
    Buy next bar at HighS(0) + passo stop;
    SellShort next bar at LowS(0) - passo stop;
end;
SetStopContract; SetStopLoss(3000);
SetExitOnClose;
```

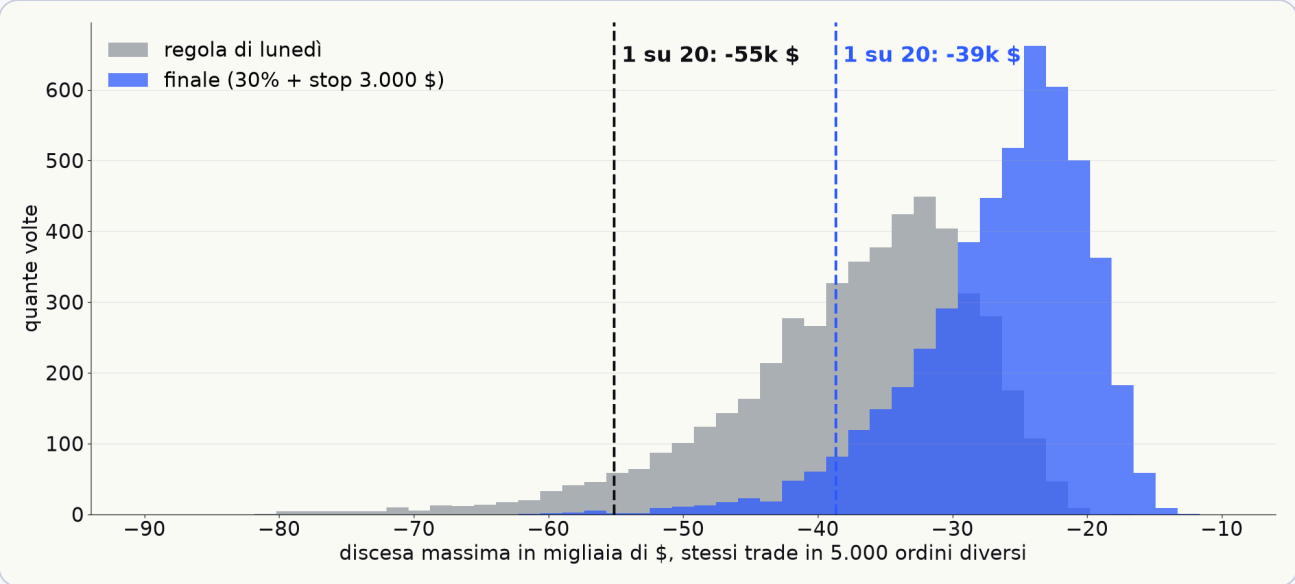
Cosa insegna. Lo stop non fa guadagnare di più: toglie il giorno da −16.000 $. E un risultato si controlla su due motori: in Python la finale sembrava molto meglio, in MultiCharts guadagna di più a operazione ma il netto ÷ discesa è pari. Si sceglie la versione che si riesce a tenere accesa.

TORTURA 7

Monte Carlo: *quanto può andare male*

PROMPT 8 Rimescola le operazioni

```
Tortura 7, Monte Carlo. Per la regola base e per la finale rimescola l'ordine delle operazioni 10.000
volte e calcola ogni volta la discesa massima. Dammi mediana e 5° percentile (1 caso su 20) e il
periodo più lungo senza nuovi massimi. Grafici: 200 equity line rimescolate disegnate in trasparenza,
con sopra in colore pieno quella vera (il «ventaglio» delle storie possibili), e un istogramma delle
discese con le due versioni e una linea sul caso 1 su 20.
```



	Discesa vissuta	Mediana	1 caso su 20
Regola di lunedì	−27.281 $	circa −35.700 $	circa −55.100 $
Finale	−24.305 $	circa −25.000 $	circa −38.700 $

Cosa insegna. La discesa che abbiamo vissuto è stata fortunata. Il capitale si decide sul caso brutto, e una strategia sola ha già passato due volte due anni e mezzo senza nuovi massimi: per questo si lavora con un portafoglio.

L'offerta del Bootcamp è aperta fino al 26/11

DAL TEST AL CONTO

GC, micro o oro spot? *Cosa cambia*

	GC (100 once)	MGC micro (10 once)	Oro spot XAUUSD
Un punto vale	100 $	10 $	quante once compri
Commissione IBKR (Pro, fissa)	0,85 $ a contratto per lato	0,25 $ a contratto per lato	in % del controvalore (vedi il listino IBKR)
Tasse di borsa e regolamentari	circa 1,50 $ per lato (stima: verificala nell'anteprima dell'ordine in TWS)	circa 0,50 $ per lato (stima)	—
Un tick	0,1 punti = 10 $	0,1 punti = 1 $	—
Guadagno medio, senza costi	173 $	17,3 $	proporzionale alle once
Con commissioni, tasse, stop + 1 tick e 1 tick in uscita	155 $ (−18 $)	14,5 $ (−2,8 $)	dipende dallo spread del broker

Il trucchetto: stop + 1 tick

Nel backtest l'ordine stop si riempie appena il prezzo tocca il livello. Dal vivo no: spesso il prezzo tocca e torna indietro, e tu non entri. Per non illuderti, fai entrare il backtest solo se il prezzo **supera** il livello di un tick, e metti commissioni e slittamento nelle proprietà della strategia.

```
Buy next bar at HighS(0) + MinMove / PriceScale stop;
SellShort next bar at LowS(0) - MinMove / PriceScale stop;
```

In MultiCharts: **Format Signals** → **Properties** → **Commission** 2,35 $ per contratto e **Slippage** 10 $ per contratto (1 tick sul GC). Su TradingView: Proprietà della strategia → Commissione e Slippage in tick.

Come si adatta la regola

Micro MGC: stessa regola, stessi orari, tutto diviso per dieci. Lo stop di emergenza diventa 300 $. È il modo per partire con un capitale piccolo: la discesa da mettere in conto (1 caso su 20) è circa 4.000 $ invece di 39.000 $.

Oro spot o CFD: stessa giornata (dalle 18:00 alle 17:00 di New York), ma i prezzi sono quelli del broker e non c'è il volume di borsa. Su IBKR l'oro spot si chiama XAUUSD (London Gold); il CFD sull'oro dipende dal broker. Prima di usarla, rifai il prompt 0 con i dati di quel prodotto: la regola si prova sui prezzi che userai davvero.

E ADESSO?

Hai visto come si scarta *una strategia*

Lunedì hai costruito una regola, stasera l'hai messa sotto sette torture. Un trader che vive di sistemi lo fa su decine di regole, poi le mette insieme in un portafoglio e sa quando spegnerle. È quello che facciamo in Quant Trader Academy.

SMART QUANT

700 €

listino 800 €

- Da zero alla prima strategia live in 12 settimane
- Piattaforme, programmazione di base, validazione
- 3 strategie complete a codice aperto
- Tuo per sempre

LIFETIME QUANT · IL PIÙ SCELTO

2.500 €

prezzo pieno 4.500 €

- **3 mesi di QuantPortfolioManager inclusi**
- Tutto Smart, più oltre 15 strategie a codice aperto
- Python, TradingView, portafogli, machine learning e AI
- Community, webinar dal vivo, Quant Strategy Builder

Garanzia 30 giorni	rimborso se hai completato al massimo il 30% del percorso: una mail ad academy@quantaste.com
Non sei sicuro?	prenota la consulenza: il prezzo resta bloccato fino al giorno della call
Il broker	chi apre un conto MEXEM (Interactive Brokers) dalla nostra pagina entro il 26/11, con almeno 2.000 € di deposito, ha commissioni scontate e il 15% delle commissioni indietro, per sempre
Pagamento	carta, PayPal in 3 rate, bonifico

L'offerta del Black Friday chiude giovedì 26/11 a mezzanotte

Con lei sparisce anche il replay delle serate. Tutto, prezzi compresi, è qui: **academy.quantaste.com/guarda-il-replay**

Giovedì 19/11 alle 20:30: le vostre domande e la Mastery 2027, a posti contati.

Materiale a scopo esclusivamente formativo ed educativo. Non costituisce consulenza finanziaria, raccomandazione personalizzata o invito a investire. I numeri sono simulazioni su dati storici dell'oro (future GC, 1 contratto, senza costi salvo dove indicato): risultati passati non garantiscono risultati futuri. Il trading di futures e strumenti a leva comporta rischi elevati, inclusa la perdita totale del capitale.