FILOSOFITRADING

DA ZERO A 1 MILIARDO IN QUATTRO MOSSE

FilosofiTrading è una società (SRL) nata nell'agosto 2024 con l'obiettivo di guadagnare lavorando sui mercati, unito ad un solido progetto culturale. Dopo un anno si vedono i primi risultati, già superiori alle attese. FilosofiTrading sta diventando e diventerà leader di mercato nei settori in cui opera.

TRADING SYSTEM
AGGIORNAMENTO RISULTATI AL 31 DICEMBRE 2025

Il prodotto di punta di FilosofiTrading è il trading system che lavora con l'indicatore DF. Dopo 35 anni di studio, di ricerca e di lavoro, e dopo 8 mesi di programmazione e test, il sistema "indicatore DF / trading system" è finito, ha iniziato in settembre la prima fase di trading in demo e produce già risultati notevoli.

FILOSOFITRADING

Risultati del trading system

Nei primi 4 mesi di demo il trading system ha prodotto i risultati seguenti.

Nel mese di settembre 2025 l'operatività in demo sul MINISP ha generato un guadagno di 5.787,50 dollari (in 9 giorni effettivi), con una performance mensile del 12,86%.

Nel mese di ottobre 2025 l'operatività in demo sul MINISP ha generato un guadagno di 13.375 dollari, con una performance mensile del 29,72%.

Nel mese di novembre 2025 l'operatività in demo sul MINISP ha generato un guadagno di 24.575 dollari, con una performance mensile del 54,61%.

Nel mese di dicembre 2025 l'operatività in demo sul MINISP ha generato un guadagno di 13.237,50 dollari, con una performance mensile del 29,42%.

Tutti i numeri di performance (ROI, return on investment) sono calcolati sul margine di 45.000 dollari richiesto da Interactive Brokers per tradare 2 contratti MINISP, la size massima con cui lavora il trading system.

Nei primi 4 mesi di test, l'operatività in demo sul MINISP ha generato un guadagno complessivo finale di 56.975 dollari, con una performance del 126,61% quadrimestrale, pari al 379,83% su base annua.

Il 1 febbraio 2026, se tutti i problemi tecnici ancora esistenti saranno risolti, è previsto l'inizio del trading con denaro reale.

FilosofiTrading avrà un numero illimitato di copie del trading system in uso, compatibilmente con la sua dotazione patrimoniale.

Ma soprattutto FilosofiTrading avrà una quota del 20% di tutti i guadagni che otterrò, in ogni modo, dal trading system, e specificamente cedendone in uso 100 copie a clienti istituzionali e/o privati. Sto già facendo accordi in tal senso.

Equity-line di settembre



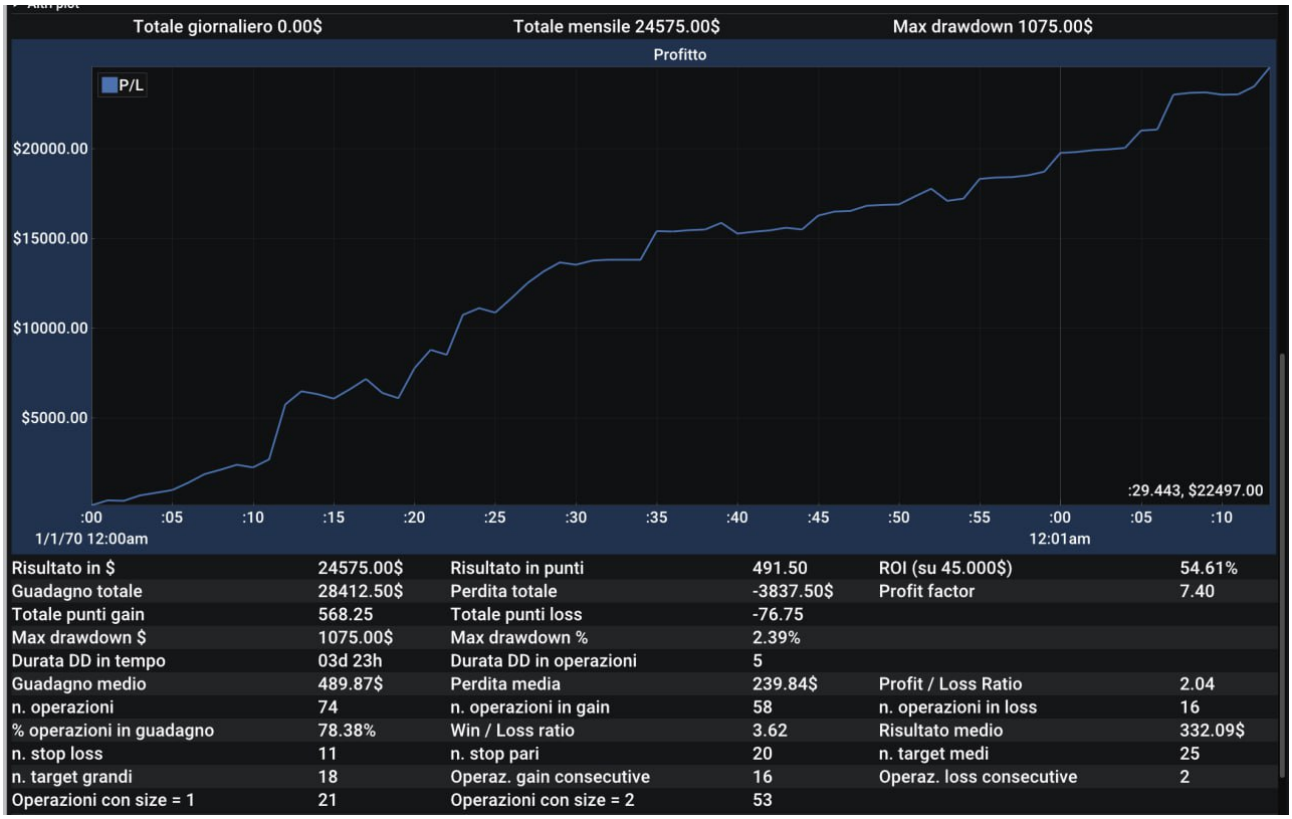
Risultato in $	5887.50$	Risultato in punti	117.75	ROI (su 45.000$)	13.08%
Guadagno totale	7375.00$	Perdita totale	-1487.50$	Profit factor	4.96
Totale punti gain	147.50	Totale punti loss	-29.75		
Max drawdown $	787.50$	Max drawdown %	1.75%		
Durata DD in tempo	07d 04h	Durata DD in operazioni	4		
Guadagno medio	491.67$	Perdita media	135.23$	Profit / Loss Ratio	3.64
n. operazioni	26	n. operazioni in gain	15	n. operazioni in loss	11
% operazioni in guadagno	57.69%	Win / Loss ratio	1.36	Risultato medio	226.44$
n. stop loss	6	n. stop pari	11	n. target medi	4
n. target grandi	5	Operaz. gain consecutive	3	Operaz. loss consecutive	4
Operazioni con size = 1	14	Operazioni con size = 2	11		

Equity-line di ottobre



Risultato in $	13375.00$	Risultato in punti	267.50	ROI (su 45.000$)	29.72%
Guadagno totale	17150.00$	Perdita totale	-3775.00$	Profit factor	4.54
Totale punti gain	343.00	Totale punti loss	-75.50		
Max drawdown $	950.00$	Max drawdown %	2.11%		
Durata DD in tempo	03d 09h	Durata DD in operazioni	8		
Guadagno medio	306.25$	Perdita media	377.50$	Profit / Loss Ratio	0.81
n. operazioni	66	n. operazioni in gain	56	n. operazioni in loss	10
% operazioni in guadagno	84.85%	Win / Loss ratio	5.60	Risultato medio	202.65$
n. stop loss	10	n. stop pari	17	n. target medi	31
n. target grandi	8	Operaz. gain consecutive	15	Operaz. loss consecutive	2
Operazioni con size = 1	34	Operazioni con size = 2	32		

Equity-line di novembre



Risultato in $	24575.00$	Risultato in punti	491.50	ROI (su 45.000$)	54.61%
Guadagno totale	28412.50$	Perdita totale	-3837.50$	Profit factor	7.40
Totale punti gain	568.25	Totale punti loss	-76.75		
Max drawdown $	1075.00$	Max drawdown %	2.39%		
Durata DD in tempo	03d 23h	Durata DD in operazioni	5		
Guadagno medio	489.87$	Perdita media	239.84$	Profit / Loss Ratio	2.04
n. operazioni	74	n. operazioni in gain	58	n. operazioni in loss	16
% operazioni in guadagno	78.38%	Win / Loss ratio	3.62	Risultato medio	332.09$
n. stop loss	11	n. stop pari	20	n. target medi	25
n. target grandi	18	Operaz. gain consecutive	16	Operaz. loss consecutive	2
Operazioni con size = 1	21	Operazioni con size = 2	53		

Equity-line di dicembre



Risultato in $	13237.50$	Risultato in punti	264.75	ROI (su 45.000$)	29.42%
Guadagno totale	17662.50$	Perdita totale	-4425.00$	Profit factor	3.99
Totale punti gain	353.25	Totale punti loss	-88.50		
Max drawdown $	850.00$	Max drawdown %	1.89%		
Durata DD in tempo	00d 00h 32m	Durata DD in operazioni	4.00		
Guadagno medio	238.68$	Perdita media	232.89$	Profit / Loss Ratio	1.02
n. operazioni	93	n. operazioni in gain	74	n. operazioni in loss	19
% operazioni in guadagno	79.57%	Win / Loss ratio	3.89	Risultato medio	142.34$
n. stop loss	14	n. stop pari	34	n. target medi	35
n. target grandi	10	Operaz. gain consecutive	16	Operaz. loss consecutive	2
Operazioni con size = 1	44	Operazioni con size = 2	49		

ANALISI SINTETICA DEI RISULTATI

Nei primi 4 mesi di demo, dal 9 settembre al 31 dicembre 2025, il Trading system ha fatto 259 operazioni:

41 chiuse in stop-loss (15,83%);
82 chiuse con lo stop in pari (31,66%);
95 chiuse a target medio (36,68%);
41 chiuse a target grande (15,83%).

Nei tecnicismi dell'operatività ci sono diversi modi di chiusura della posizione. Per semplificazione comunicativa, qui consideriamo solo 4 tipi di chiusura, con una classificazione di tipo numerico:
operazioni chiuse in stop-loss: sono le operazioni con una perdita maggiore di 100 $;
operazioni chiuse con stop in pari: sono quelle con un risultato compreso tra -100 $ e +100 $;
operazioni chiuse con target medio: sono quelle con un risultato compreso tra +100 $ e +500 $;
operazioni chiuse con target grande: sono quelle che hanno un guadagno maggiore di 500 $.

Nota sui margini

Il trading system trada con una size da 1 a 2 contratti. Per ora l'unico broker con cui si interfaccia il trading system è Interactive Brokers.

Per operare sul MINISP (S&P500 future, contratto grande) viene richiesto da IB, alla data attuale, un margine di circa 20.000 $ per ogni contratto. Per il funzionamento del TS è richiesto dunque un margine di 20.000 x 2 contratti = 40.000 $. Tuttavia è opportuno avere sul conto una disponibilità di almeno 45.000 $.

Per operare sul MICROSP (S&P500 future, contratto piccolo) viene richiesto da IB, alla data attuale, un margine di circa 2.000 $ per ogni contratto. Per il funzionamento del TS è richiesto dunque un margine di 2.000 x 2 contratti = 4.000 $. Tuttavia è opportuno avere sul conto una disponibilità di almeno 4.500 $.

I margini richiesti dal broker sono una percentuale del valore nominale del contratto, e cambiano leggermente, con il variare del prezzo, ma variano anche a seconda del broker.

FILOSOFI TRADING

PARAMETRI DI VALUTAZIONE (SETTEMBRE / DICEMBRE 2025)

Risultato in $	56.975 $
Risultato in punti	1.141,5
Return on Investment quadrimestrale	126,61%
Return on Investment annuo	379,83%
Guadagno totale	70.600 $
Perdita totale	13.525 $
Profit Factor	5,22
Risultato medio	220 $
Massimo Drawdown $	1.075 $
Massimo Drawdown %	2,39%
Numero di trades	259
Operazioni in guadagno	203
Operazioni in perdita	56
Guadagno medio	347,78 $
Perdita media	241,52 $
Profit/Loss ratio	1,44
Win/Loss Ratio	3,625
Operazioni in guadagno %	78,37%
Operazioni chiuse in stop-loss	41
Operazioni chiuse con stop in pari	82
Operazioni chiuse a target medio	95
Operazioni chiuse a target grande	41
Winning Streak	16
Losing Streak	4
Operazioni con size = 1	113
Operazioni con size = 2	145

FILOSOFI TRADING

Numeri attesi e prossimi step

Le attese per i primi mesi di trading reale, da marzo 2026, sono per (almeno) 10.000 $ di guadagno al mese per ogni copia.

Eliminando tutti gli errori di vario tipo ancora presenti, eliminando i bug, completando le ottimizzazioni e testando alcune ipotesi operative, ritengo possibile, da maggio 2026, un guadagno medio superiore a 15.000 $ al mese, pari al 400% su base annua (numeri calcolati sul margine di 45.000 dollari).

Il drawdown è già adesso molto basso, e verrà sempre più ridotto.

La prima fase di trading in demo è iniziata il 9 settembre 2025.
La fase in demo vera e propria è iniziata il 1 ottobre 2025.
Verranno fatti alcuni back-test.

Se i prossimi risultati della fase in demo e del back-test saranno in linea con le attese, e se tutti i problemi tecnici saranno risolti, dal 1 marzo 2026 una copia del trading system verrà usata sul conto Interactive Brokers di FilosofiTrading per tradare il MICROSP con soldi veri.

Se i primi risultati del trading in reale confermeranno le attese, e in assenza di altri problemi, dall'1 aprile 2026 una seconda copia del TS verrà usata sul conto Interactive Brokers di FilosofiTrading per tradare il MICROSP con soldi veri. Contestualmente il TS sarà messo a disposizione dei primi clienti per il trading con il MICROSP.

Se i risultati del trading in reale confermeranno le attese, e in assenza di altri problemi, dall'1 maggio 2026 una copia del TS verrà usata sul conto Interactive Brokers di FilosofiTrading per tradare il MINISP con soldi veri.
Contestualmente il TS sarà messo a disposizione dei primi clienti per il trading con il MINISP.

Possibili accordi di utilizzo

Mostrando i numeri, spiegando la logica tecnica generale alla base della loro formazione e la loro stabilità nel tempo, e anzi il probabile miglioramento in prospettiva futura, ho già fatto alcuni pre-accordi, che saranno formalizzati alla conferma, per almeno 4 mesi di trading in real, dei numeri esposti. Tra questi, un pre-accordo con una banca per la cessione in uso di 20 copie, a partire da maggio 2026.

Considerando un risultato atteso medio prudenziale di +10.000$ al mese per ogni copia, questa operazione ha un risultato atteso vicino a 200.000$ al mese. Io avrò metà di questi guadagni. FilosofiTrading avrà il 20% di tale somma.

Ci saranno comunque altri accordi simili a questo.

Note conclusive

Il progressivo miglioramento tendenziale dei risultati esposti, dai più antichi ai più recenti, dipende da continui miglioramenti nel protocollo operativo, a seguito di analisi, test e ottimizzazioni delle regole e dei parametri di funzionamento, dalla eliminazione di bug e dalla soluzione di altri problemi tecnici.

Ad oggi ci sono ancora errori di programmazione e bug, modifiche da fare, soluzioni da testare, errori da correggere, test e back-test da completare. Tutti questi problemi verranno risolti entro il mese di febbraio 2026. Superata questa fase con successo, i risultati avranno un ulteriore miglioramento.

Il funzionamento dell'indicatore e le regole operative del trading system sono esposte in varie centinaia di pagine. L'elaborato finale (teoria + codice) verrà brevettato e coperto da copyright e altre tutele tecnico-legali, a cura di uno studio tecnico-legale di Milano, in modi tali da poterne tutelare la proprietà intellettuale senza rivelarne i segreti.
Verrà predisposto e registrato il marchio e verranno fatte una valutazione del trading system e una perizia.

Nota legale

FilosofiTrading non ha la proprietà del Trading system, ma ha un diritto d'uso su un numero illimitato di copie, compatibilmente con la sua disponibilità patrimoniale (con riferimento ai margini richiesti dal broker).
La proprietà del trading system è di Stefano Bagnoli.

FILOSOFI TRADING

SQUARE POINT CONTEST

Lo Square Point contest è una gara internazionale di gestione riservata a società finanziarie selezionatissime. Square Point Capital è una società di gestione anglo-americana con 182,2 miliardi di massa totale gestita, della quale sono co-advisor. Con questa gara Square Point attua la gestione di uno dei suoi fondi azionari, con una massa gestita di circa 70 miliardi di dollari.
FilosofiTrading ha un account nello Square Point Contest dal 14 aprile 2025. Prima partecipavo per conto di una società svizzera (ARCAS sagl di Mendrisio).

Nel secondo trimestre 2025 sono arrivato 31mo con 9.924.670$ di guadagno, usando mediamente 50 milioni di dollari. La performance nel trimestre è stata del 19,84% su base trimestrale, pari al 79,40% su base annua.

Il compenso pagato da SquarePoint per il risultato di questo trimestre è stato di 4.100$, pari a 3.521,71€.



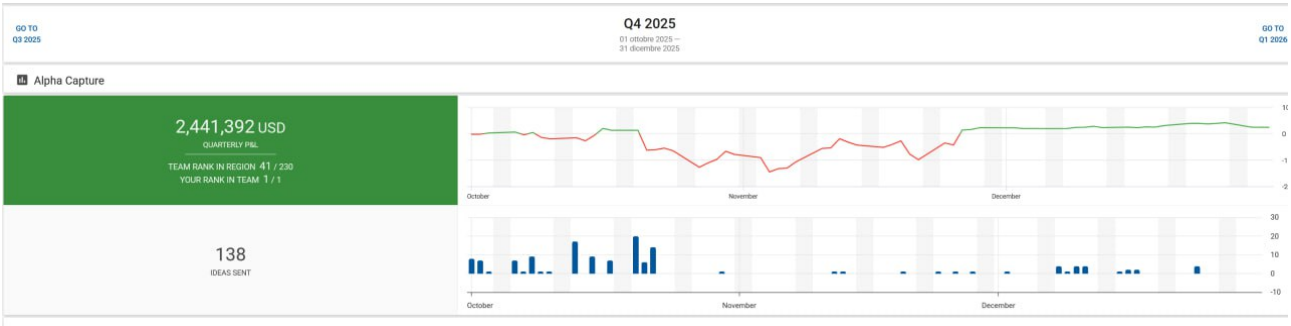
Nel terzo trimestre 2025 sono arrivato 17mo con 9.346.290$ di guadagno, usando mediamente 50 milioni di dollari. La performance nel trimestre è stata del 18,69% su base trimestrale, pari al 74,77% su base annua.

Il compenso pagato da SquarePoint per il risultato di questo trimestre è stato di 10.000$, pari a 8.564,20€.



Nel quarto trimestre 2025 sono arrivato 41mo con 2.441.392$ di guadagno, usando mediamente 50 milioni di dollari. La performance nel trimestre è stata del 4,88% su base trimestrale, pari al 19,53% su base annua.

Il compenso che verrà pagato da SquarePoint per il risultato di questo trimestre sarà di 8.800$, al cambio del 9 gennaio pari a circa 7.560€.



Tutti i risultati che ho ottenuto nello Square Point contest negli ultimi 3 anni sono visibili qui: https://www.filosofitrading.it/mercati/.

I risultati futuri saranno verosimilmente spesso in questo ordine di grandezza, e 10.000 dollari medi per ogni trimestre sono un obiettivo realizzabile.

Ricordo che il Contest è fatto da segmenti trimestrali; anche i pagamenti sono trimestrali: partono da 500 $ con risultato positivo e aumentano a seconda della posizione in classifica:

entrando nei primi 20 il guadagno è di almeno 10.000 dollari;
entrando nei primi 10 il guadagno è di almeno 15.000 dollari;
vincendo la gara il guadagno va dai 100.000 ai 200.000 dollari.

Considerazioni

Nello Square Point contest dall'inizio del 2023, cioè da quando partecipo, ho chiuso ogni trimestre in guadagno;

nel secondo e nel terzo trimestre 2025 ho ottenuto in entrambi i casi una performance pari o superiore al 75% netto su base annua.

Inoltre va ribadito che:

i soldi dello Square Point contest sono soldi veri e non demo;

i compensi pagati da Square Point sono molto alti, e la gara offre una notevole visibilità internazionale;

il portafoglio costruito nel contest ha anche una copertura in futures, stabilita dalla piattaforma; quello esposto è dunque il risultato al netto della copertura: il risultato lordo sarebbe ancora superiore;

in ogni operazione Square Point applica un costo di entrata, che dipende dalla capitalizzazione, dalla liquidità del titolo e dal book in quell'istante: in media si tratta di circa 10.000 $ per ogni 2 milioni di dollari scambiati.

In conclusione:

ritengo molto probabile il raggiungimento stabile di posizioni alte nella classifica della gara, ottenendo tra 5.000 e 10.000 $ di compenso per ogni trimestre;

ritengo possibile vincere almeno un segmento trimestrale, ottenendo un compenso compreso tra 100.000 e 200.000 $: oltre al compenso, questa vittoria mi darebbe una visibilità notevole a livello internazionale, fermo restando che già i risultati attuali mi stanno aprendo molte porte.

ATTIVITÀ DEL CENTRO STUDI

Il Centro Studi FilosofiTrading sta continuando la sua attività con i miei studi, le mie ricerche, le analisi sui singoli titoli e sul quadro economico; continua la pubblicazione della Newsletter "Punti di vista".

Ho iniziato un'attività strutturata di studio dei migliori titoli quotati sui mercati azionari mondiali, e ho costruito una *Lista preferiti* di 100 titoli che faccio poi ruotare nel portafoglio di Square Point, e che in questa fase sono in grado di ottenere performance molto alte. Per ogni titolo analizzato elaboro un report. Ogni report viene costantemente aggiornato. Tutti i report formeranno un unico pacchetto, che poi verrà proposto in vendita a clienti istituzionali.

Il portafoglio della *Lista preferiti* è attualmente specializzato sui titoli dell'oro.

La Scuola è già attiva con i corsi di economia, investimento e trading (nel segmento economico), e presto saranno attivi anche i percorsi di filosofia, buddismo, arte della felicità e tecniche di scrittura (nel segmento culturale). Un'entrata marginale ma non irrilevante per FilosofiTrading è prevista anche da qui.

BREVETTO DEL TRADING SYSTEM

Ho incaricato un prestigioso studio tecnico-legale di Milano di assistermi nella messa in opera di tutte le azioni tecnico-legali possibili per proteggere la proprietà intellettuale del trading system, i segreti delle sue formule e scoperte, e i diritti economici del suo utilizzo, e altri strumenti idonei a massimizzarne la resa economica: brevetto, diritto d'autore, segreto commerciale e marchio.

Una volta ottenute queste tutele, quando il trading system sarà completato e ottimizzato, con i risultati esposti confermati da almeno 12 mesi di trading in demo, 2 anni di back-test e 6 mesi di trading in reale, ne farò fare una valutazione certificata e una perizia da un professionista abilitato.

ATTIVITÀ CULTURALI

Le attività economiche sono solo una parte, sebbene prevalente, del progetto FilosofiTrading. C'è poi una parte culturale, accennata nel sito, che emergerà nei prossimi anni, quando la parte economica avrà raggiunto i suoi obiettivi.

RISULTATI E RISULTATI ATTESI

Il bilancio 2025 chiude con un utile lordo di circa 10.000 euro, superiore alle attese, che erano di 7.500 euro. Seguiranno aggiornamenti.

L'utile atteso per il 2026 è oggi pari a 360.000 euro.
L'utile atteso per il 2027 è oggi pari a 1.800.000 euro.
L'utile atteso per gli anni successivi, ad oggi, è notevolmente superiore, perché nel frattempo saranno implementati anche altri trading system; tuttavia oggi è difficile quantificarne una misura, seppure ipotetica.

Tutti i risultati attesi, e i relativi bilanci di previsione, aggiornati al 30 giugno 2025, sono visibili nel sito in fondo alla pagina

https://www.filosofitrading.it/filosofitrading/.

Rimane in programma la quotazione in borsa entro il 2030.

Stefano Bagnoli

FILOSOFI TRADING