



Michele Rossi Playbook 003

ORB

Opening Range Breakout

Strumenti:

Futures

Forex

Crypto

Stile: Day Trading

Panoramica

Questa strategia si basa su un concetto semplice ma potentissimo: ogni giorno, nelle prime 15 candele da 1 minuto dopo l'apertura americana, il mercato ci mostra il suo range iniziale. Quando lo rompe, è lì che si entra. Con un rischio calcolato e un target matematico.

Aspettiamo che il prezzo definisca l'Opening Range nei primi 15 minuti — dalle 15:30 alle 15:45 italiane — e poi lavoriamo su timeframe a 5 minuti, cercando la prima chiusura netta fuori da quel box. Il trade parte lì. Stop sull'estremo opposto dell'OR, e target sempre fisso con rapporto R:R 1:2.

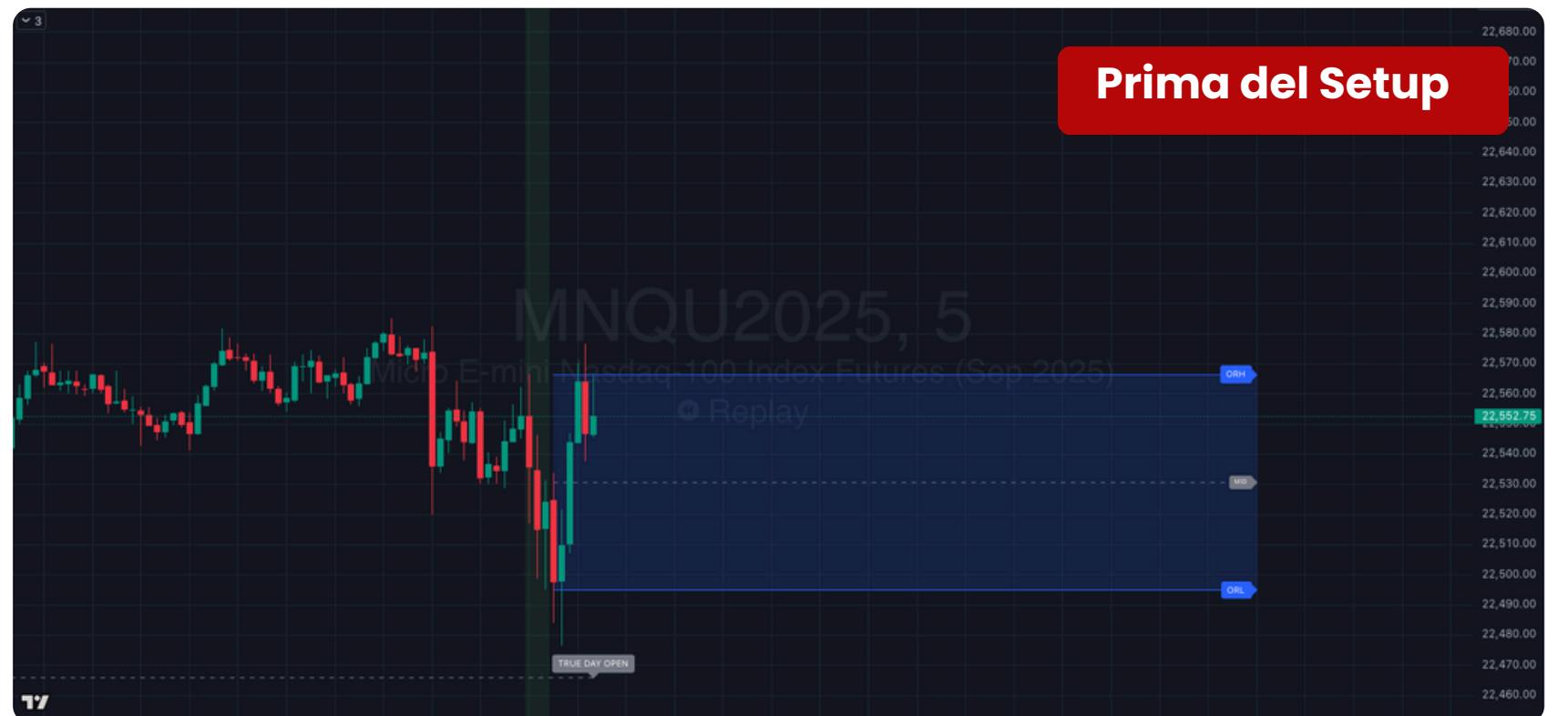
È una strategia precisa, ripetibile, chirurgica. Non anticipa niente. Reagisce. Non ti chiede opinioni, ti chiede disciplina.

Non serve analisi macro, non servono indicatori, solo il grafico e la regola: se rompe al rialzo, si compra. Se rompe al ribasso, si vende. Punto. Basta che la candela a 5 minuti chiuda fuori dal box, e si parte. Lo SL va sull'altro lato dell'OR, il TP è doppio. Nessun margine per l'interpretazione.

Funziona ovunque: Nasdaq, SP500, oro, BTC, DAX, EUR/USD... qualsiasi asset liquido, su qualsiasi sessione. Basta adattare l'orario dell'apertura e fare un backtest serio.

Non è una strategia da super trend. È una strategia da conferma. Da velocità. Da freddezza.

Vuoi colpire ogni giorno la parte più probabile del movimento, con meno rumore e più momentum? Allora l'ORB è per te.



Quando Usare questa Strategia

Usa questa strategia quando:

- Stai operando su un asset liquido e volatile (Nasdaq, SPX, Oro, BTC...) con buona reazione all'apertura della sessione.
- Il mercato ha costruito un range chiaro nei primi 15 minuti dopo l'apertura americana (15:30 – 15:45 italiane).
- C'è direzionalità nel contesto macro o news driver importanti previsti nella giornata.
- C'è abbastanza spazio fino al prossimo livello chiave per giustificare un R:R minimo 1:2.
- Hai poco tempo ma vuoi fare un'operazione rapida e disciplinata, senza rimanere davanti al grafico tutto il giorno.
- Vuoi costruire una routine operativa semplice, ripetibile e con gestione rischio fissa.

Il Concetto

Il modello ORB (Opening Range Breakout) parte da un concetto semplice: nei primi minuti dopo l'apertura, il mercato disegna un range iniziale che rappresenta lo scontro tra compratori e venditori.

Quando quel range viene rotto, parte spesso il primo impulso direzionale della giornata.

- **Costruzione** – Si traccia il massimo e il minimo tra le 15:30 e le 15:45 italiane (orario NY apertura).
- **Rottura** – Non appena una candela a 5 minuti chiude fuori dal box (senza wick di rientro), si entra.
- **Estensione** – Target fisso a R:R 1:2. Stop loss sull'estremo opposto del box. Niente gestione discrezionale.

Timeframe Usati

Questa strategia usa due timeframe ben definiti, senza top-down:

15 min

Usa il grafico a 15 minuti per tracciare il massimo (ORH) e minimo (ORL) tra le 15:30 e le 15:45 italiane. Questo è il box di riferimento per tutta la giornata.

5 min

Aspetta che una candela da 5 minuti chiuda fuori dall'OR, senza rientrare. Entra alla chiusura della candela, stop loss sull'altro lato dell'OR, take profit a 2x la distanza. Niente eccezioni. Massima disciplina.

Regole Strategia

Opening Range Bias

- Parti sempre dal range iniziale della sessione americana: dalle 15:30 alle 15:45 italiane. Questo è il tuo "campo di battaglia".
- Traccia il massimo e minimo di quel range (ORH – ORL). È da lì che nasce tutto: bias, livelli e setup.
- Fino a quando il prezzo rimane dentro l'OR, si resta flat. Nessuna fretta. Nessuna intuizione.
- L'ingresso avviene solo dopo che una candela a 5 minuti chiude fuori dal box. Non un wick, non un test: una chiusura netta.

Aspetta la Rottura Chiara e Pulita

- Serve una chiusura pulita, lontana dai bordi del box. Se c'è incertezza o rientro immediato, si scarta.
- Evita le candele con shadow lunghissime o che chiudono troppo vicine all'estremo: alto rischio di rientro.
- Le migliori rotture avvengono nelle prime 2 ore di NY (15:30–17:30 italiane). Fuori da quelle finestre, il mercato è meno esplosivo.

💡 Nota Importante

La strategia qui descritta è una base solida, ma può essere personalizzata:

- Entrata al break puro invece che in close
- Aggiunta del VWAP o altre conferme di contesto
- Uso di parziali o trailing stop
- Spostamento dello stop a BE dopo 1:1
- Adattamento alle condizioni di mercato (volatilità, contesto macro, orari)
- Il punto non è seguire la regola alla lettera, ma costruire un framework operativo chiaro, testato, replicabile.

Individua lo Spazio Operativo

- Prima di entrare, valuta lo spazio fino al primo ostacolo (livello, VWAP, zona congestione).
- Se non c'è spazio sufficiente per un R:R 1:2, il trade non si fa.
- La qualità del trade è tutto: pochi ma buoni. No rotture in mezzo al nulla o dentro congestione.

Entra nel Trade

- **Entrata:** alla chiusura di una candela M5 fuori dal box.
- (Alternativa testabile: ingresso al breakout puro, senza aspettare la chiusura, ma con conferma volume o momentum.)
- **Stop Loss:** sul lato opposto dell'OR (ORH per short, ORL per long).
- **Target:** 2x la distanza tra entry e stop. Nessun TP dinamico. Solo gestione disciplinata.

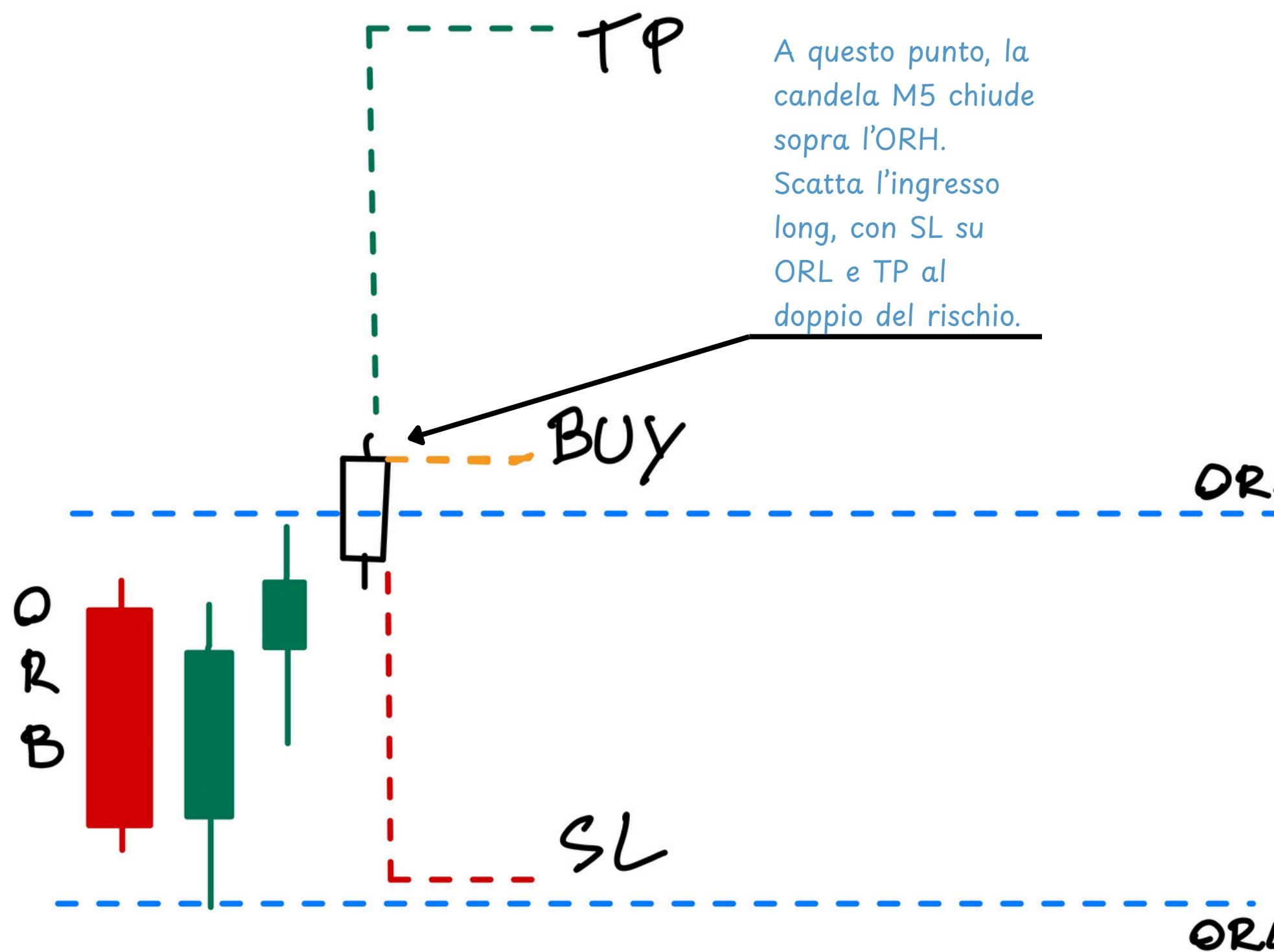
Gestisci il Trade

- Il tuo obiettivo non è prendere tutto, ma un pezzo preciso con R:R 1:2.
- Quando il prezzo raggiunge R:R 1:1, valuta di spostare lo stop a breakeven.
- Se il prezzo torna dentro l'OR con forza, il setup perde validità. Esci senza pietà.
- Evita modifiche continue. Questo setup si basa su regole fisse e ripetibilità. Testa e adatta, ma non improvvisare.

Esempio Visivo

Prima di passare all'esempio operativo su grafico reale, è utile visualizzare come si presenta un setup ORB pulito, passo dopo passo.

Il diagramma qui sotto mostra la sequenza ideale: apertura, costruzione dell'OR, breakout, ingresso, stop e target.



Il prezzo ha costruito il suo range iniziale (Opening Range) tra le 15:30 e le 15:45 italiane.

Dopo una breve fase di consolidamento, una candela da 5 minuti chiude nettamente sopra l'ORH, dando il segnale d'ingresso.

💡 Il setup è valido solo se:

- la rottura avviene con chiusura piena, senza spike di rientro
- c'è spazio fino a un livello chiave che consente un R:R minimo di 1:2
- il prezzo non rientra subito nel box (in tal caso il setup è invalidato)

📋 Checklist del Setup ORB Classico:

- ✓ Range costruito tra 15:30-15:45 (ORH-ORL)
- ✓ Candela M5 chiude sopra ORH (breakout)
- ✓ Entry alla chiusura candela
- ✓ Stop Loss su ORL (lato opposto del box)
- ✓ Target fisso R:R 1:2 (o livello chiave raggiungibile)

Pro & Contro della Strategia



Pros

- **Setup Oggettivo e Meccanico**

- Nessuna interpretazione. Hai un box, un breakout, uno stop e un target. Tutto è già scritto.

- **Velocità Operativa**

- In meno di 20 minuti dall'apertura puoi avere già un setup valido.

- **Rischio Definito, R:R Costante**

- SL sull'estremo opposto del box, TP fisso a 1:2. Stop chiaro, target replicabile.

- **Perfetta per Chi Vuole una Routine**

- Non devi seguire 10 mercati o 4 ore di analisi. Un solo asset, 15 minuti al giorno.

- **Può Essere Automatizzata**

- Le regole sono così chiare che puoi testarla, codificarla o farla eseguire da un bot.

- **Funziona su Qualsiasi Asset**

- Nasdaq, SPX, DAX, BTC, Crude, Oro, EUR/USD... dove c'è apertura e volatilità, l'ORB si applica.

- **Ti Allenà a Rispettare il Piano**

- È una strategia che ti insegna a non improvvisare. Una vera scuola di disciplina.

- **Adatta al Trading Intraday "Pulito"**

- No indicatori, no lag, solo azione del prezzo nei momenti chiave.

- **Backtestabile al Millimetro**

- Essendo basata su orari e regole fisse, puoi backtestarla senza ambiguità.

Il modello ORB è costruito per offrire entrate semplici, chiare e ad alta probabilità. Ma come ogni strategia solida, richiede disciplina e coerenza operativa.

Ecco cosa sapere prima di utilizzarla al massimo.

Nota: I “**contro**” elencati qui non sono svantaggi, ma aspetti da tenere a mente – caratteristiche importanti che richiedono pazienza, disciplina e gestione corretta per far funzionare il modello in modo efficace.



Contro

- **Alta Percentuale di Breakeven**

- Il prezzo spesso rompe, poi rientra. SL in pari è comune. Fa parte della strategia.

- **Richiede Massima Precisione Temporale**

- Se entri in ritardo o fuori tempo, rovini tutto. È una strategia da chirurgia, non da reazione lenta.

- **Non Funziona Sempre**

- nelle giornate laterali o con poca volatilità, il setup può non attivarsi o fallire in partenza.

- **Soffre i Fake Breakout**

- Non è raro che il prezzo faccia finta di rompere e poi rientri. Serve esperienza per gestirli.

- **Zero Discrezionalità = Zero Flessibilità**

- segui le regole, o il setup non è più ORB. Non ci sono “intuizioni” che tengano.

- **Pochi Setup, Tanta Pazienza**

- Spesso avrai solo 1 tentativo al giorno, e a volte nemmeno quello. Se forzi, perdi l'efficacia.

- **Non Adatta a Chi Vuole 10 Trade al Giorno**

- Se cerchi adrenalina continua, non è la strategia per te. È pensata per chi aspetta e colpisce.

- **Serve Allenamento Visivo**

- All'inizio tutto sembra “buono”. Poi impari a distinguere i breakout reali da quelli farlocchi.

Analisi Dettagliata

Parti dal grafico a 15 minuti e identifica l'Opening Range tra le 15:30 e le 15:45 italiane. In questo caso, l'indice Nasdaq stava aprendo con una volatilità contenuta ma visibile, costruendo un box stretto tra i due estremi del primo quarto d'ora.

Il prezzo ha mostrato chiari segni di indecisione iniziale, senza rompere né al rialzo né al ribasso.

Alle 15:45 il box era ben definito, con ORH a 22.566 e ORL a 22.494.

26 Giugno 2025 – Nasdaq in attesa di direzionalità

Alle ore 16:20, una candela da 5 minuti chiude nettamente sopra l'ORH, rompendo la parte alta del box con corpo pieno e senza spike. La rottura avviene con volumi crescenti, confermando l'intenzione direzionale.

Sul grafico M5, si vede bene come il breakout sia stato immediato e deciso.

L'ingresso long avviene alla chiusura della candela delle 16:20, con SL posizionato su ORL e TP calcolato con R:R 1:2



➡ A quel punto avevamo:

- Box OR ben formato con 15 minuti di storico
- Chiusura M5 sopra l'ORH (breakout pulito)
- SL definito sull'ORL e TP a 2x distanza
- Volume crescente sulla candela di breakout
- Nessun ostacolo visibile nel breve (spazio operativo valido)



Rottura e Setup

Alle 16:20, la candela di breakout chiude sopra l'ORH tracciato tra le 15:30 e le 15:45 italiane: setup attivo.

- **Entrata:** Buy su chiusura candela 16:20
- **Stop Loss:** Posizionato su ORL (estremo inferiore dell'Opening Range)
- **Target:** Area TP con R:R 1:2
- **Timeframe operativo:** 5 minuti

Questa era una configurazione A+: range ben definito, breakout pulito, nessun ostacolo tecnico vicino, e tanto spazio fino al target.

Il prezzo ha rotto senza esitazioni addirittura Ri-Testando ORH ad ulteriore conferma



Il prezzo ha reagito con continuità e senza ritracciamenti, consolidando sopra l'ORH e poi accelerando progressivamente.

- ✓ Alle 20:10, il target viene raggiunto perfettamente a quota 22.727, segnando un profitto pieno con R:R 1:2.
Nessun rientro nel box, nessun falso breakout, gestione perfetta.

Trade Review – Nasdaq M5 | ORB Long

- ✓ OR ben costruito (range chiaro, volumi coerenti)
- ✓ Chiusura M5 fuori dal box = trigger operativo
- ✓ SL preciso, TP matematico (no interpretazioni)
- ✓ Timing e momentum impeccabili

🧠 **Un esempio da textbook:** entra solo se hai tutto chiaro, gestisci con freddezza, e lascia che la statistica lavori per te.

Criteri Strategia

Timeframes

- **15m** – per costruire l'Opening Range tra le 15:30 e le 15:45 italiane
- **5m** – per l'ingresso operativo alla chiusura della candela di breakout
- **1H / 4H** – opzionali per contestualizzare spazio operativo e livelli chiave

Regole Ingresso

- **Traccia ORH e ORL** tra le 15:30 e le 15:45 italiane (prima mezz'ora di NY)
- **Aspetta** la chiusura di una candela M5 fuori dal range: breakout valido
- **Non anticipare mai**: entra solo a chiusura, non sul break live
- **Stop Loss**: sempre sull'estremo opposto del box
- **Target**: rapporto rischio/rendimento minimo 1:2

Il setup è valido solo se:

- La candela M5 chiude fuori dal box con corpo pieno, no wick
- C'è spazio operativo pulito (niente resistenze immediate)
- Il prezzo non rientra subito nel range (setup invalidato)

Stop Loss

- Sempre sull'estremo opposto dell'OR
- È il punto che invalida il breakout: se viene preso, fine del trade
- Non allargare mai lo SL: la forza deve mostrarsi subito

Take Profit

- Target fisso con R:R 1:2
- Oppure struttura chiara (resistenza/supporto netto)
- Se il prezzo accelera puoi:
 - Trailing SL sotto i minimi crescenti
 - Lasciar correre finché non chiude contro (es. su H1)

Gestione del Rischio

- Sposta lo stop in pari a R:R 1:1
- Se il prezzo rientra nel box, setup invalidato: chiudi
- Se ti accorgi che il breakout è avvenuto troppo vicino al target... non entrare. È un'opportunità persa, non un'occasione da forzare

Automatizza la Strategia



Ottieni