

SCHEDA INFORMATIVA

Gruppo di lavoro AIAF

Analisi tecnica e analisi volumetrica dei mercati finanziari

Socio Responsabile e Responsabile scientifico:

Ing. **Fabio Michettoni** fabiomichettoni@gmail.com

Premessa

Il Gruppo si propone come obiettivo quello di valutare l'efficacia degli assiomi dell'analisi tecnica classica e della moderna analisi volumetrica come evoluzione della prima al fine di evidenziare le migliorie nell'applicazione operativa dell'analisi volumetrica sui mercati finanziari. La valutazione comprende i risvolti di trading algoritmico e HFT.

Finalità e Contenuti del lavoro

Il presente Gruppo di Lavoro è stato formato al fine di elaborare un Quaderno basato sulla falsariga del seguente Indice:

1. L'Analisi Tecnica euristico quantitativa
 - Elaborazioni di serie storiche di prezzi e volumi
 - Elaborazioni di serie storiche di prezzi e indici di mercato
 - Elaborazioni di serie storiche di sottoinsiemi numerici
2. L'analisi Tecnica applicata
 - I sistemi automatici
 - I sistemi flessibili
 - Intelligenza artificiale e sistemi esperti
3. L'Analisi Tecnica 2.0 – I nuovi paradigmi dei mercati finanziari
 - Attualità e nuove prospettive di analisi
 - L'analisi flussometrica
 - Come si forma il volume
 - Relazione tra volume e prezzo
 - Applicazione di metodi scientifici e di inferenza statistica ai segnali di trading
 - Protocolli di indagine e campionamento per cluster dei risultati ottenuti
 - Il calcolo probabilistico
4. Le nuove frontiere di approccio al trading
 - Cenni di High Frequency Trading e strategie applicate

Risultati

Punti chiave del Quaderno:

- L'analisi tecnica classica si basa sullo studio dei trend dei mercati in un contesto bidimensionale prezzo/tempo. Il volume rappresenta la terza, e la più importante, dimensione in un'analisi più ampia e più efficace.
- Volume Analysis:
 - analisi di struttura
 - analisi statica dei volumi
 - analisi dinamica dei volumi
- L'evoluzione dell'Analisi Tecnica orientata dalla tecnologia a supporto delle metodiche applicative
- High Frequency Trading e Agorhythmic Trading: fenomeni nati dall'evoluzione dell'analisi volumetrica

Tempi

Importante indicare:

la data inizio lavori: Novembre 2022

la data prevista fine lavori _____

Partecipanti

- Aga Barberini
- Pietro Bertolini
- Luigi Gilli
- Fabio Michettoni
- Salvatore Scarano
- Paolo Schiavini

Invitiamo tutti coloro che fossero interessati a partecipare a questa iniziativa a manifestare la loro disponibilità.

- **Aga Barberini:** agaskorupinskabarberini@gmail.com
- presso la Segreteria AIAF: info@aiaf.it