

## 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](mailto: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](mailto:agaskorupinskabarberini@gmail.com)
- presso la Segreteria AIAF: [info@aiaf.it](mailto:info@aiaf.it)