

23-gen-2018

Vedremo di far un'analisi statistica sui movimenti rialzisti di FtseMib.

Iniziamo dal FtseMib ed analizziamo il movimento rialzista dal minimo del 2 gennaio sino alla chiusura di ieri.

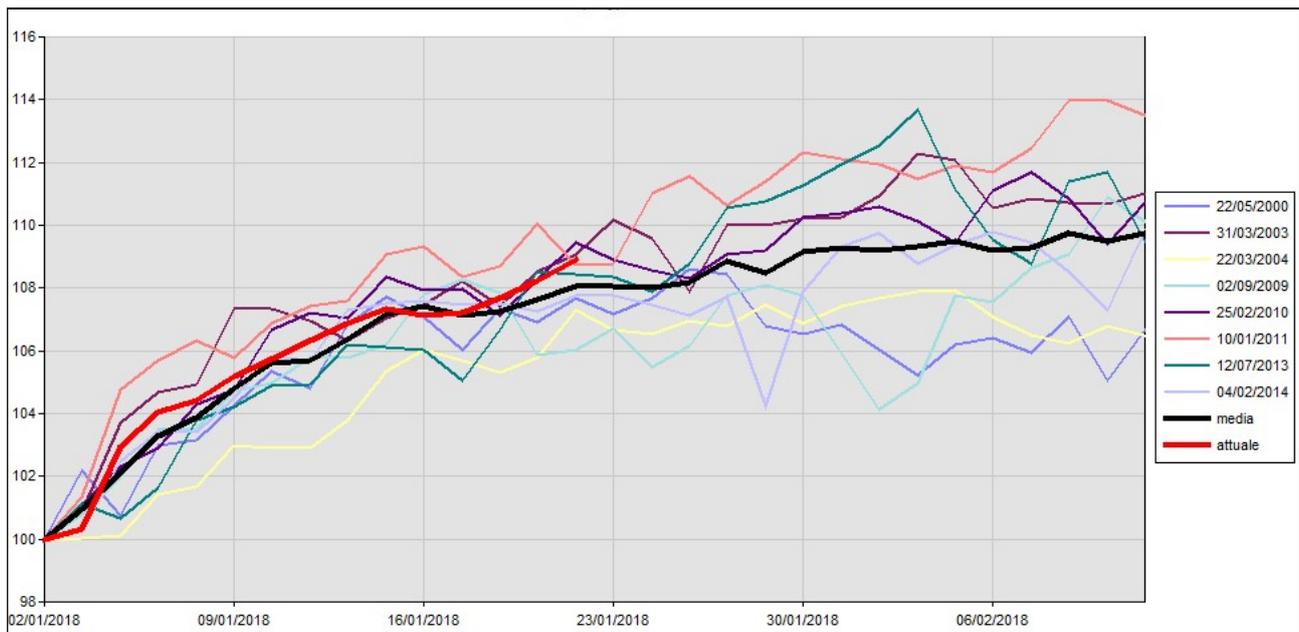
Vediamo il grafico su dati giornaliero a partire da fine agosto 2017:



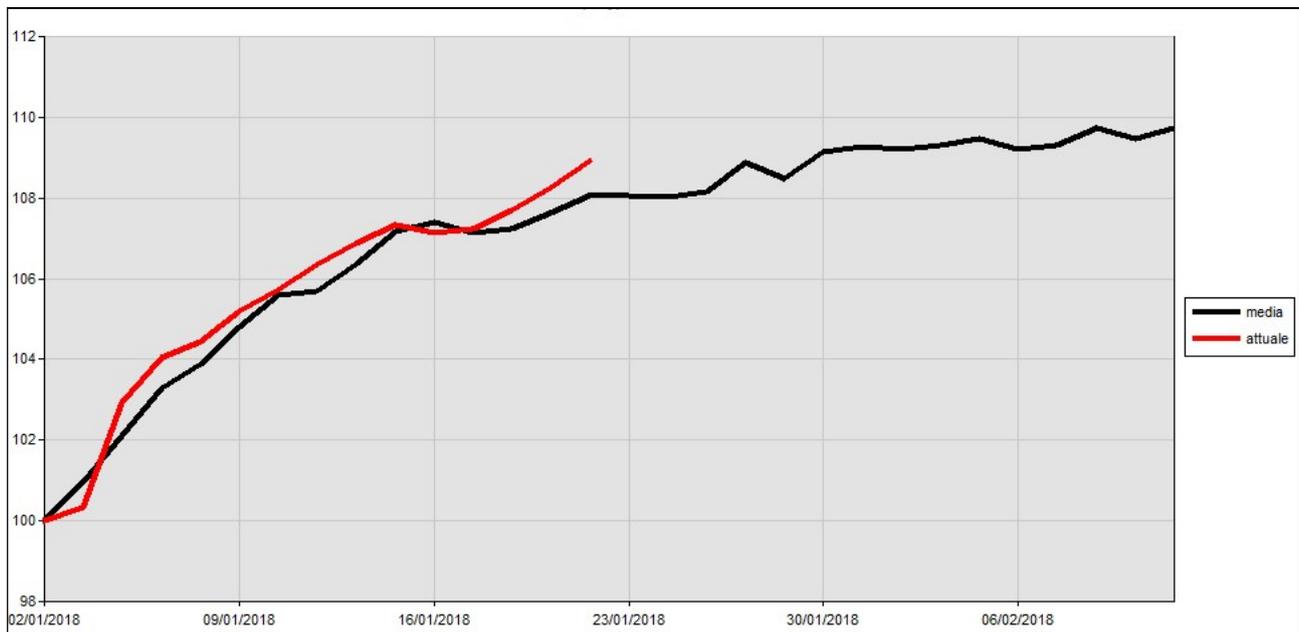
Come si vede c'è stata una rottura ribassista (vedi freccia verde) che sembrava la conferma di un Testa e Spalle ribassista. A seguire un forte rialzo ben segnalato da un'apertura in gap rialzista il 4 gennaio, con barra ampia e Volumi sopra alla media (vedi frecce rosse).

Dalla chiusura del 2 gennaio (quasi uguale a quella del 29 dicembre) sino alla chiusura del 22 gennaio c'è stato un rialzo del 9,36% in 15 gg. Un buon rialzo, ma che si è verificato decine e decine di volte in un analogo numero di giorni. Il Fatto eclatante è che su 15 gg ben 14 si sono chiusi con valori superiori al gg precedente- inoltre c'è stata una sequenza di 9 gg al rialzo che costituisce un caso unico dal 1998.

Indaghiamo più a fondo e valutiamo il frattale, ovvero le situazioni del passato più simili a quella attuale, tenendo conto che il 2 gennaio è stato un minimo di un certo rilievo e così deve essere per il frattale. Vediamo i risultati:



La linea rossa spessa è la fase attuale su dati giornalieri. La scala di sinistra è il rialzo % a partire da 100. Quindi 108 corrisponde a +8%. Come si vede ci sono molte situazioni del passato con andamento assai simile, ma nessuno ha la sequenza di rialzi come quella attuale. Come vedete ho fatto anche una proiezione a 15 gg operativi sulla base del passato. La vediamo meglio di seguito (dove ho tolto i vari frattali del passato):



La linea nera è la proiezione frattale frutto di una media pesata delle similitudini del passato. Ebbene, come si vede la prevalenza rialzista potrebbe proseguire sino a circa fine gennaio, per poi lasciare spazio ad una lateralità (o lieve rialzo).

Ribadisco come l'eccezionalità della fase attuale sia la sequenza di 14 giorni rialzisti su 15. Come sappiamo oggi (23 gennaio) si è chiuso con una discesa.

In un successivo report vedremo di fare un'analisi Statistico/Frattale del rialzo dell'S&P500 in particolare dai minimi del 18 agosto 2017.