

Marco Leone presenta le nuove frontiere del Trading Finanziario ad Alta frequenza grazie alle tecnologie innovative legate all'Intelligenza Finanziaria ed ai Sistemi di Supporto alle Decisioni all'Incontro dal titolo Scientific Research as a Bridge for Overcoming the New Challenges from U.S.A. to Europe promosso dalla Constantinian University di New York del 20 Giugno 2015. Il titolo del suo contributo è stato

Automatismi e nuove tecnologie per la finanza ed il trading online

M. Leone, G. Iovane

Il dottor Marco Leone dopo essersi laureato in Informatica, ha conseguito il dottorato di ricerca in Ingegneria dell'Informazione occupandosi di tecnologie informatiche per la Sicurezza. Oggi è il responsabile dell'Area di Ricerca in Algoritmi Avanzati per la Finanza all'interno del gruppo di Financial Computing coordinato dal prof. Gerardo Iovane; inoltre il dottor Leone è honorary assistant professor in Computer Science alla Constantinian University di New York.

Sommario

Il presente contributo fornisce un'analisi dei mercati finanziari emergenti finalizzata ad evidenziare le opportunità fornite dal trading automatico. A partire da una introduzione dei mercati finanziari di interesse, in particolare di quello delle valute estere (Foreign Exchange Market, FOREX), vengono analizzati i principali motivi di appeal ed evidenziate le potenzialità dei sistemi di trading automatico, connessi a specifici aspetti operativi, quali l'effetto leva (leveraging), l'high-frequency trading, la varietà di strumenti finanziari, e così via.

Il focus dell'articolo è rappresentato dai sistemi multi-agente: ciascun agente implementa una specifica strategia di trading, capace quindi di aprire e chiudere posizioni a mercato in automatico in corrispondenza di specifiche condizioni pre-impostate o processate a runtime. Gli agenti "vivono" in uno stesso ambiente, con precise regole di cooperazione, affinché le elaborazioni di un agente possano contribuire a quelle di un altro agente, e competizione, affinché l'operatività sia deputata all'agente con il potenziale più alto in un dato istante temporale.

Infine viene fornito un esempio grafico operativo di esecuzione del sistema multi-agente, che presenta esempi di cooperazione e competizione tra agenti a mercato.