



Becas colaboración curso 2016/2017

Fecha: 28 Junio 2016

Vicerrectorado de Investigación, Innovación y Transferencia

Subcomisión de I+D+i

Propuesta del departamento *MATEMATICA APLICADA*

Núm Proyecto: 2016/26/00005

Responsable

Peris Manguillot, Alfredo

E-mail

aperis@mat.upv.es

Ext.

76623

Título proyecto

TRATAMIENTO DE SEÑALES EN ESTRATEGIAS DE TRADING

Valoración proyecto

3,8

Descripción proyecto

El objetivo fundamental del trabajo es analizar distintos aspectos de relevancia en trading de mercados financieros, fundamentalmente la detección de patrones de tendencia, mediante herramientas de tratamiento de señales. Se precisan conceptos básicos matemáticos y de tratamiento de señales a utilizar y manejo de Matlab. Se pretende analizar distintos índices (Dow Jones, DAX, etc.) en periodos de tiempo largos (superiores a 10 años) para poder validar la existencia de ciertos patrones que indican una determinada tendencia (alcista o bajista), y a partir de ellos establecer unas estrategias de trading que contradicen la hipótesis de eficiencia del mercado.

Actividades a realizar por el alumno

El alumno deberá familiarizarse a utilizar el software matemático necesario para el análisis de las señales financieras (fundamentalmente Matlab).

Posteriormente, bajo la guía del tutor responsable, deberá implementar la detección de determinados patrones en las señales financieras. Finalmente, se extraerán aquellas estrategias de mejor comportamiento sobre los índices analizados, que se formalizarán en un proyecto final.

Horario

15 horas semanales en horario a determinar en función de las circunstancias del alumno.