

Giornate del thanksgiving

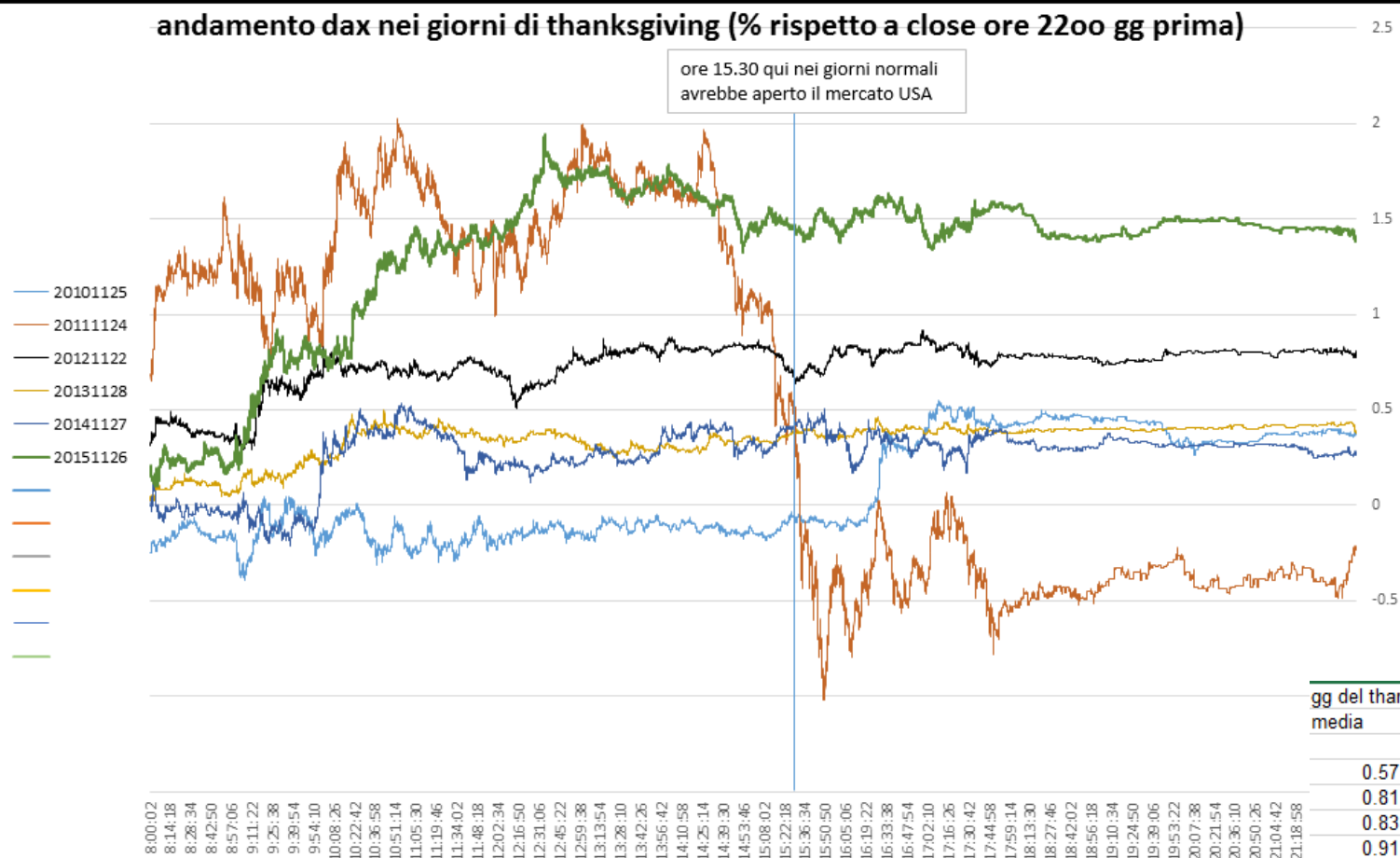
Analisi dell'andamento del range del dax
nel giorno del thanksgiving e nel giorno
successivo, dati dal 2010 al 2015

Il Thanksgiving è una delle festività più sentite in USA. Cade il
quarto giovedì di novembre. Tutti i mercati sono chiusi.

La festività si prolunga il venerdì, con mercati aperti con orario
ridotto

andamento dax nei giorni di thanksgiving (% rispetto a close ore 2200 gg prima)

ore 15.30 qui nei giorni normali
avrebbe aperto il mercato USA



In questo grafico sono chartati gli andamenti del dax nei giorni del ThanksGiving dal 2010 al 2015.

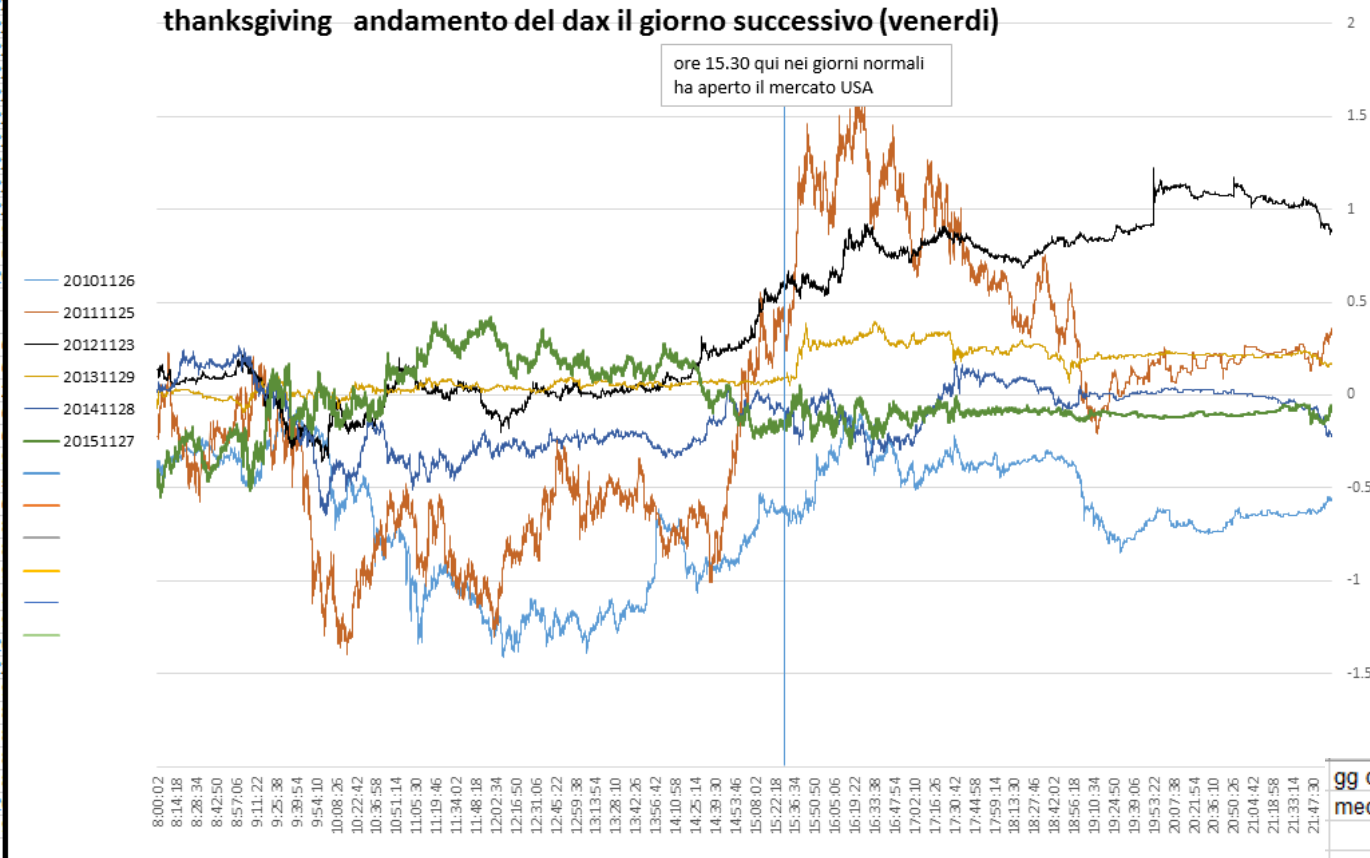
Nella tabella in basso, ci sono i range di escursione (high – low) di ogni giorno, ora per ora.

C'è un giorno «outlier», il 24 nov 2011, periodo di forti tensioni per l'attacco all'Italia.. Escludendo quella sessione, che alza molto la media, otteniamo valori non molto lontani dal range medio cui cci ha abituato il dax negli ultimi tempi.

gg del thanksgiving	20101125	20111124	20121122	20131128	20141127	20151126
media	8:00:02					
0.18	9:00:00	0.71	0.18	0.16	0.21	0.23
0.57	10:00:00	0.44	0.96	0.47	0.28	0.44
0.81	11:00:00	0.44	1.37	0.56	0.50	0.74
0.83	12:00:00	0.44	1.37	0.56	0.50	0.74
0.91	13:00:00	0.44	1.37	0.56	0.50	0.74
0.92	14:00:00	0.44	1.37	0.61	0.50	0.74
0.92	15:00:00	0.44	1.37	0.62	0.50	0.74
1.20	16:00:00	0.44	3.04	0.62	0.50	0.74
1.29	17:10:00	0.94	3.04	0.65	0.50	0.74
1.29	18:00:00	0.94	3.04	0.65	0.50	0.74
1.29	19:00:00	0.94	3.04	0.65	0.50	0.74
1.29	20:00:00	0.94	3.04	0.65	0.50	0.74
1.29	21:00:00	0.94	3.04	0.65	0.50	0.74
1.29	22:00:00	0.94	3.04	0.65	0.50	0.74

thanksgiving andamento del dax il giorno successivo (venerdì)

ore 15.30 qui nei giorni normali
ha aperto il mercato USA



In questo grafico sono chartati gli andamenti del dax il giorno SUCCESSIVO al TG. In USA i mercati sono aperti ma con orario ridotto, che si riflette sulla price action.

Nella tabella in basso, ci sono i range di escursione (high – low) di ogni giorno, ora per ora.

Rispetto al giorno del TG, che riporto per comodità di lettura sulla sinistra, si nota un leggero aumento del range daily

gg del thanksgiving	20101125	20111124	20121122	20131128	20141127	20151126
media	8:00:02					
	9:00:00	0.18	0.71	0.16	0.21	0.23
0.57	10:00:00	0.44	0.96	0.28	0.44	0.82
0.81	11:00:00	0.44	1.37	0.56	0.74	1.26
0.83	12:00:00	0.44	1.37	0.56	0.74	1.37
0.91	13:00:00	0.44	1.37	0.56	0.74	1.84
0.92	14:00:00	0.44	1.37	0.61	0.74	1.84
0.92	15:00:00	0.44	1.37	0.62	0.74	1.84
1.20	16:00:00	0.44	3.04	0.62	0.74	1.84
1.29	17:10:00	0.94	3.04	0.65	0.74	1.84
1.29	18:00:00	0.94	3.04	0.65	0.74	1.84
1.29	19:00:00	0.94	3.04	0.65	0.74	1.84
1.29	20:00:00	0.94	3.04	0.65	0.74	1.84
1.29	21:00:00	0.94	3.04	0.65	0.74	1.84
1.29	22:00:00	0.94	3.04	0.65	0.74	1.84

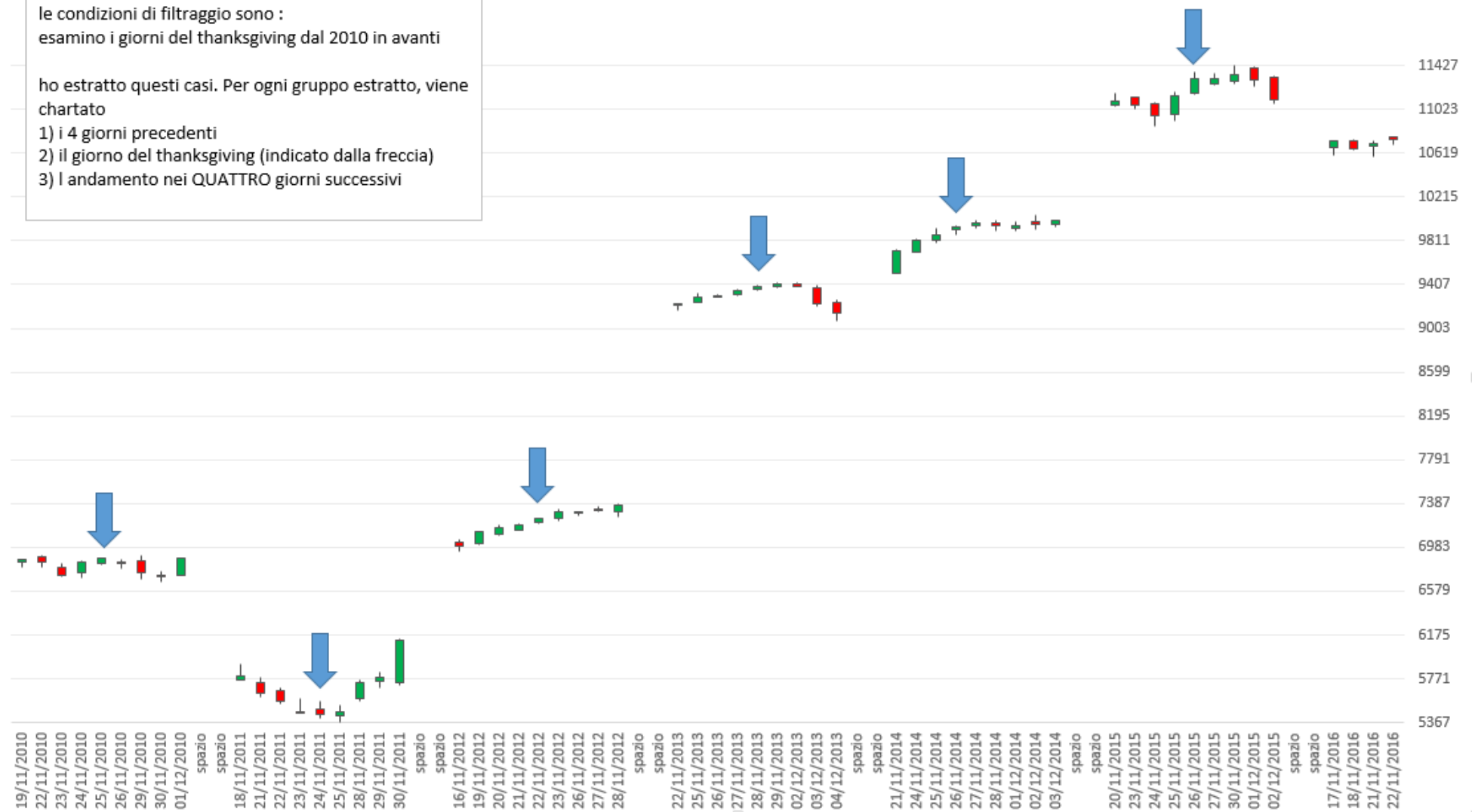
gg dopo il Thanksg	20101126	20111125	20121123	20131129	20141128	20151127
media	8:00:02					
	9:00:00	0.25	0.81	0.12	0.11	0.23
0.72	10:00:00	0.44	1.52	0.57	0.19	0.72
0.84	11:00:00	0.97	1.63	0.57	0.19	0.78
0.93	12:00:00	1.29	1.63	0.57	0.19	0.92
0.94	13:00:00	1.36	1.63	0.57	0.19	0.92
0.94	14:00:00	1.36	1.63	0.57	0.19	0.92
0.96	15:00:00	1.36	1.63	0.68	0.19	0.92
1.27	16:00:00	1.36	2.86	1.03	0.48	0.92
1.34	17:10:00	1.36	3.01	1.28	0.48	0.92
1.34	18:00:00	1.36	3.01	1.28	0.48	0.92
1.34	19:00:00	1.36	3.01	1.28	0.48	0.92
1.39	20:00:00	1.36	3.01	1.58	0.48	0.92
1.39	21:00:00	1.36	3.01	1.58	0.48	0.92
1.39	22:00:00	1.36	3.01	1.58	0.48	0.92

Thanksgiving : giorni precedenti 4; giorni successivi 4

le condizioni di filtraggio sono :
esamino i giorni del thanksgiving dal 2010 in avanti

ho estratto questi casi. Per ogni gruppo estratto, viene
chartato

- 1) i 4 giorni precedenti
- 2) il giorno del thanksgiving (indicato dalla freccia)
- 3) l'andamento nei QUATTRO giorni successivi



3 giorni prima		20101122	20111121	20121119	20131125	20141124	20151123
media	8:00:02						
	9:00:00	0.27	0.72	0.24	0.30	0.61	0.22
0.95	10:00:00	0.31	2.85	0.56	0.57	0.65	0.72
1.08	11:00:00	0.45	2.85	0.58	0.77	1.11	0.72
1.10	12:00:00	0.47	2.85	0.59	0.88	1.11	0.72
1.21	13:00:00	0.68	2.85	0.89	0.96	1.13	0.72
1.25	14:00:00	0.97	2.85	0.89	0.96	1.13	0.72
1.32	15:00:00	1.19	2.85	1.09	0.96	1.13	0.72
1.44	16:00:00	1.21	2.85	1.60	0.96	1.29	0.72
1.56	17:10:00	1.43	3.20	1.74	0.96	1.29	0.72
1.56	18:00:00	1.43	3.21	1.76	0.96	1.29	0.72
1.59	19:00:00	1.57	3.21	1.76	0.96	1.29	0.72
1.59	20:00:00	1.57	3.21	1.76	0.96	1.29	0.72
1.62	21:00:00	1.57	3.21	1.76	0.96	1.29	0.95
1.62	22:00:00	1.57	3.21	1.76	0.96	1.29	0.95
1 giorno prima		20101124	20111123	20121121	20131127	20141126	20151125
media	8:00:02						
	9:00:00	0.13	0.72	0.20	0.12	0.32	0.41
0.72	10:00:00	0.64	1.66	0.56	0.23	0.69	0.53
0.96	11:00:00	0.68	2.05	0.83	0.23	0.69	1.30
1.03	12:00:00	0.78	2.05	0.83	0.23	0.69	1.63
1.19	13:00:00	1.33	2.34	0.83	0.23	0.69	1.72
1.24	14:00:00	1.45	2.34	0.83	0.34	0.74	1.75
1.34	15:00:00	1.71	2.34	0.83	0.34	0.80	2.04
1.50	16:00:00	1.91	2.34	0.83	0.73	0.80	2.38
1.52	17:10:00	1.99	2.34	0.83	0.73	0.80	2.44
1.52	18:00:00	1.99	2.36	0.83	0.73	0.80	2.44
1.53	19:00:00	2.04	2.36	0.83	0.73	0.80	2.44
1.54	20:00:00	2.07	2.36	0.83	0.73	0.80	2.44
1.54	21:00:00	2.07	2.36	0.83	0.73	0.80	2.44
1.57	22:00:00	2.22	2.43	0.83	0.73	0.80	2.44

2 giorni prima		20101123	20111122	20121120	20131126	20141125	20151124
media	8:00:02						
	9:00:00	0.39	0.51	0.27	0.18	0.29	0.19
0.77	10:00:00	0.88	0.93	0.68	0.25	0.52	1.32
0.95	11:00:00	1.08	1.36	0.68	0.26	0.91	1.39
1.01	12:00:00	1.08	1.36	0.78	0.26	1.17	1.39
1.03	13:00:00	1.20	1.37	0.80	0.26	1.17	1.39
1.05	14:00:00	1.23	1.37	0.80	0.26	1.17	1.48
1.32	15:00:00	1.23	2.27	0.84	0.26	1.41	1.92
1.38	16:00:00	1.58	2.27	0.85	0.26	1.41	1.92
1.52	17:10:00	1.64	2.52	1.33	0.31	1.41	1.92
1.56	18:00:00	1.77	2.64	1.33	0.31	1.41	1.92
1.56	19:00:00	1.77	2.64	1.33	0.31	1.41	1.92
1.56	20:00:00	1.77	2.64	1.33	0.31	1.41	1.92
1.56	21:00:00	1.77	2.64	1.33	0.31	1.41	1.92
1.56	22:00:00	1.77	2.64	1.33	0.31	1.41	1.92
gg del thanksgiving		20101125	20111124	20121122	20131128	20141127	20151126
media	8:00:02						
	9:00:00	0.18	0.71	0.18	0.16	0.21	0.23
0.57	10:00:00	0.44	0.96	0.47	0.28	0.44	0.82
0.81	11:00:00	0.44	1.37	0.56	0.50	0.74	1.26
0.83	12:00:00	0.44	1.37	0.56	0.50	0.74	1.37
0.91	13:00:00	0.44	1.37	0.56	0.50	0.74	1.84
0.92	14:00:00	0.44	1.37	0.61	0.50	0.74	1.84
0.92	15:00:00	0.44	1.37	0.62	0.50	0.74	1.84
1.20	16:00:00	0.44	3.04	0.62	0.50	0.74	1.84
1.29	17:10:00	0.94	3.04	0.65	0.50	0.74	1.84
1.29	18:00:00	0.94	3.04	0.65	0.50	0.74	1.84
1.29	19:00:00	0.94	3.04	0.65	0.50	0.74	1.84
1.29	20:00:00	0.94	3.04	0.65	0.50	0.74	1.84
1.29	21:00:00	0.94	3.04	0.65	0.50	0.74	1.84
1.29	22:00:00	0.94	3.04	0.65	0.50	0.74	1.84

Confrontando il range del gg del TG con i tre giorni precedenti, si nota una riduzione del range del dax, tuttavia non così imponente come ci si potrebbe aspettare. Direi nell'ordine del 20% in meno.