



Provincia
di Milano



PROGeTICA S.r.l.

“Metodo di trattamento di dati relativi a serie storiche di performance di mercati e/o strumenti finanziari”

Breve Anagrafica Brevetto

Numero di Domanda EPO: **03425137.1**

Inventori: **Dr. Gaetano Megale e Dr. Claudio Grossi**

Titolare: **PROGeTICA S.r.l.**

Data del primo deposito: **01.04.2003**

Data di concessione brevetto: **in itinere**

L'impresa

PROGeTICA S.r.l. è una società di consulenza indipendente nata nel 1994 da un gruppo di professionisti, che progetta e realizza sistemi e strumenti per istituzioni e intermediari del settore assicurativo e finanziario.

Le attività della società sono orientate alla creazione di modelli professionali, al disegno di prodotti, alla formazione, agli strumenti di marketing, alla gestione vendite e tecnologie nel campo degli investimenti, delle assicurazioni, della previdenza e dell'indebitamento.



PROGeTICA

www.progetica.it

L'invenzione

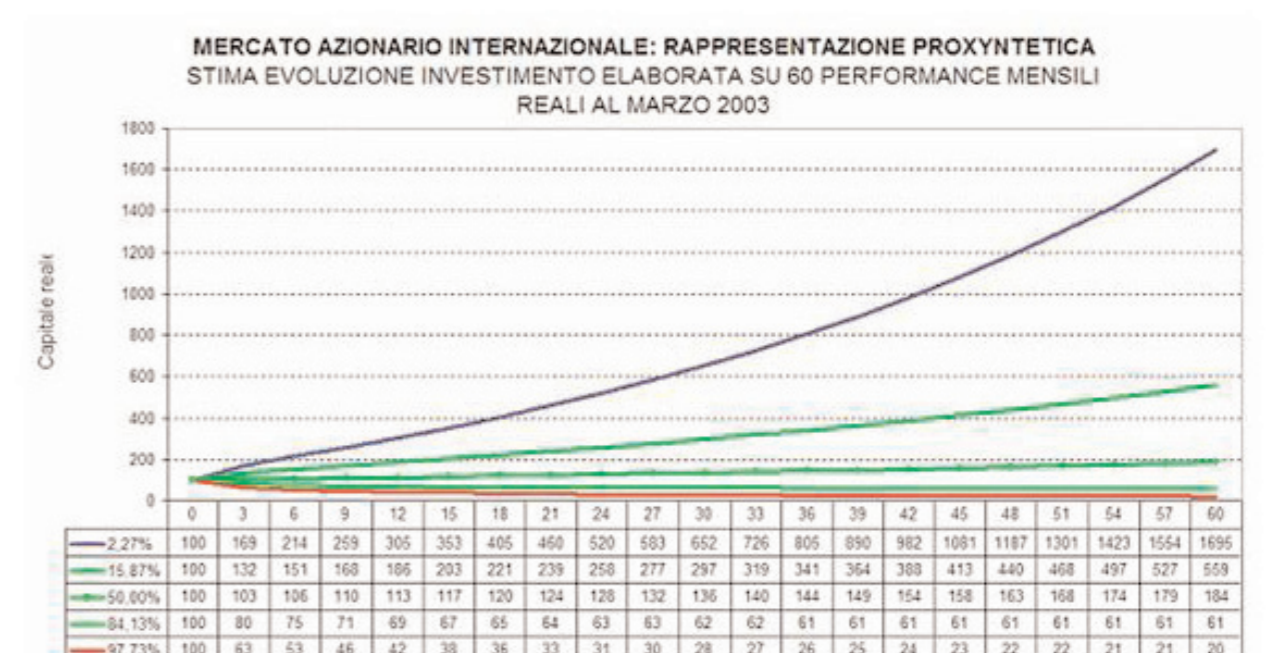
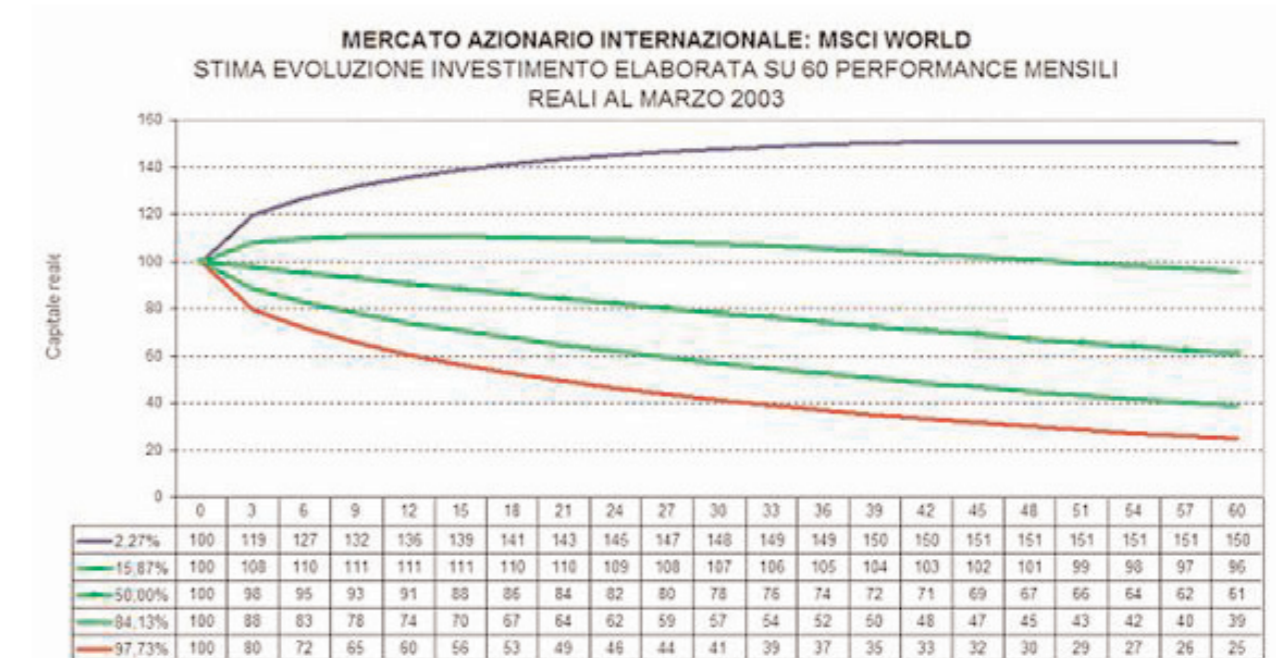
Proxynetica® è una modalità innovativa per interpretare ed elaborare i profili di rischio-rendimento dei mercati e delle attività finanziarie migliorando l'accuratezza delle analisi e l'affidabilità delle stime statistiche.

La metodologia consiste nella rielaborazione di serie storiche di performance e dunque nella definizione di una nuova serie storica che sintetizza il potenziale di rischio-rendimento derivato da un congruo numero di serie storiche del mercato in analisi, ricavate su diversi periodi temporali, mantenendo elevata la rappresentatività del campione verso l'universo relativamente alle covarianze tra i mercati e/o gli strumenti finanziari.

Proxynetica® può essere elaborata in diverse versioni, in funzione del grado di affidabilità della stima statistica che si intende perseguire e dell'orizzonte temporale di analisi e valutazione desiderato.

Le Applicazioni

Proxynetica® permette di superare gli attuali limiti derivanti dall'elaborazione di serie storiche di performance nell'ambito finanziario della ricerca ed applicazione. L'utilizzo di Proxynetica® al posto delle comuni serie storiche delle performance consente di fornire una informazione approfondita dei profili di rischio-rendimento dei mercati e/o degli strumenti finanziari in una prospettiva storica che permetta di considerare una pluralità di condizioni economico-finanziarie e dunque il timing dell'investimento in differenti scenari storici. I risultati sperimentali hanno dimostrato che Proxynetica® tende ad operare sul trend del mercato a medio-lungo termine, evitando di prendere in considerazione gli stati dell'investimento di eccessivo ribasso e rialzo rispetto al trend medesimo.



Confronto tra la valutazione ex ante del profilo di rischio-rendimento dell'indice fondamentale MSCI World su una serie storica di 60 performance mensili reali e la medesima analisi mediante la sua rappresentazione Proxynetica®

Il Mercato

L'invenzione ha come naturale mercato di sbocco quello degli investitori finanziari, delle assicurazioni e del credito, consentendo il superamento degli inconvenienti derivanti dal tradizionale utilizzo delle serie storiche.

Allo stesso tempo il trovato costituisce per PROGeTICA un asset strategico per la realizzazione di propri modelli d'investimento, assicurativi e di indebitamento, caratterizzati da un maggior grado di affidabilità rispetto all'offerta attuale.