

# HELIOPHANT

---

## Εβδομαδιαία Ποσοτική Ανάλυση Αγορών

Το παρόν έγγραφο αποτελεί ενδεικτικό ερευνητικό report, σχεδιασμένο αποκλειστικά για σκοπούς παρουσίασης και αξιολόγησης. Η ανάλυση βασίζεται σε ποσοτικές και στατιστικές μεθοδολογίες και δεν συνιστά επενδυτική συμβουλή ή προτροπή για συναλλαγές.

### 1. Πεδίο Ανάλυσης και Μεθοδολογικό Πλαίσιο

Οι αγορές προσεγγίζονται ως σύνθετα, στοχαστικά δυναμικά συστήματα, με μη γραμμική συμπεριφορά, συσσωμάτωση μεταβλητότητας και εναλλαγή καθεστώτων. Η ανάλυση εστιάζει σε περιγραφικά στατιστικά μεγέθη, δομή τάσεων, δυναμική μεταβλητότητας και δείκτες κινδύνου.

Η εξεταζόμενη περίοδος αφορά την προηγούμενη εβδομάδα συναλλαγών, με χρήση ημερήσιων τιμών κλεισίματος. Δεν πραγματοποιείται πρόβλεψη μελλοντικής συμπεριφοράς.

### 2. Δείκτης S&P 500 – Δομική Ανάλυση

Κατά την εξεταζόμενη εβδομάδα, ο δείκτης S&P 500 παρουσίασε στατιστικά σταθερή ανοδική τάση, με περιορισμένη διασπορά σε σχέση με προηγούμενα καθεστάτα αυξημένης μεταβλητότητας.

Η ανάλυση της δομής της τάσης υποδεικνύει διατήρηση θετικού μεσοπρόθεσμου καθεστώτος, χωρίς ενδείξεις ακραίας υπερεπέκτασης.

Οι μετρικές κινδύνου και οι δείκτες μέγιστης υποχώρησης παρέμειναν εντός αναμενόμενων ορίων, χωρίς εντοπισμό δομικής ασυνέχειας.

### 3. Bitcoin – Μεταβλητότητα και Καθεστάτα Συμπεριφοράς

Η δυναμική της τιμής του Bitcoin χαρακτηρίστηκε από αυξημένη διακύμανση σε σύγκριση με τους παραδοσιακούς χρηματιστηριακούς δείκτες.

Η ποσοτική ανάλυση υποδεικνύει μεταβατικό καθεστώς, με εναλλαγές μεταξύ φάσεων κατευθυνόμενης κίνησης και περιόδων ενοποίησης.

Η προσέγγιση εστιάζει στην αναγνώριση καθεστώτων και όχι στη ντετερμινιστική πρόβλεψη βραχυπρόθεσμων κινήσεων.

### 4. Συγκριτική Ανάλυση Αγορών

Η συγκριτική εξέταση αναδεικνύει τη δομική διαφοροποίηση μεταξύ αγορών μετοχών και αγορών ψηφιακών περιουσιακών στοιχείων.

Οι συντελεστές συσχέτισης για την εξεταζόμενη περίοδο παρέμειναν σε χαμηλά έως μέτρια επίπεδα.

## **5. Ερμηνεία Κινδύνου και Περιορισμοί**

Τα αποτελέσματα περιορίζονται από το πεπερασμένο μέγεθος δείγματος και το χρονικό εύρος της παρατήρησης.

Οι ποσοτικοί δείκτες ερμηνεύονται πιθανοκρατικά και όχι απολύτως.

## **6. Συμπεράσματα**

Η ανάλυση καταδεικνύει τον τρόπο με τον οποίο ποσοτικά πλαίσια μπορούν να χρησιμοποιηθούν για την ερμηνεία της συμπεριφοράς των αγορών, χωρίς την επίκληση προβλεπτικών ισχυρισμών.

Αποποίηση ευθύνης: Το παρόν έγγραφο παρέχεται αποκλειστικά για ερευνητικούς και επιδεικτικούς σκοπούς. Δεν αποτελεί επενδυτική συμβουλή ούτε σύσταση συναλλαγών.