



Finanças Quantitativas

Vantagens

Você pode se perguntar:

O mercado financeiro não é fácil de entender. Por que então devemos usar programação?

Obtenção de dados

Tenha acesso a uma ampla variedade de dados

Análise de dados

Autonomia para desenvolver suas próprias análises

Combinação de estratégias

Já imaginou criar estratégias que combinam análise técnica com análise fundamentalista?

Avaliação de estratégias

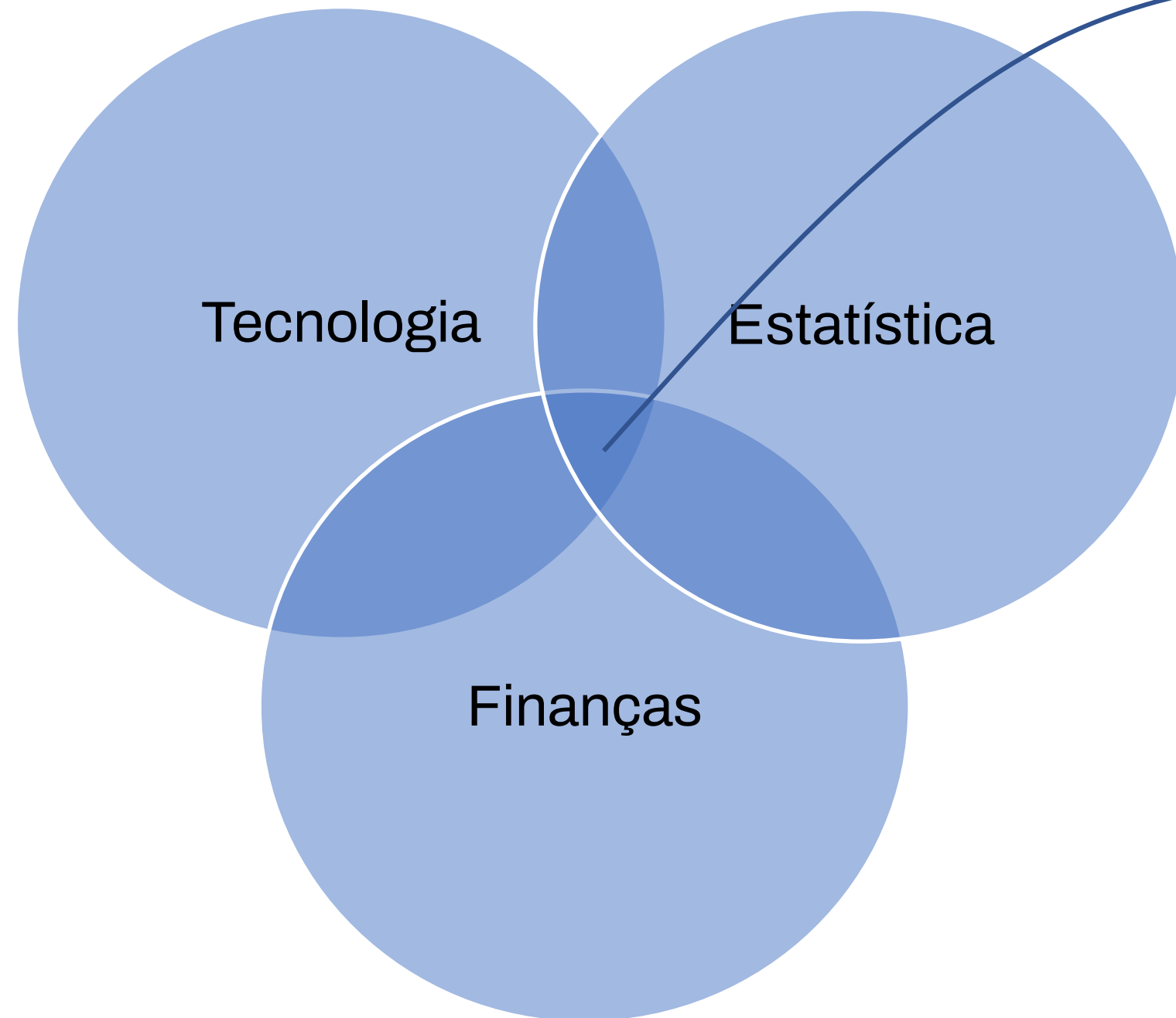
Teste o desempenho das suas estratégias com dados do passado

Automação do trading

Crie rotinas para envio de ordens automaticamente



Finanças quantitativas



Finanças quantitativas, ou simplesmente “quant”

Área que une o mercado financeiro ao mundo de dados, estatística e tecnologia.

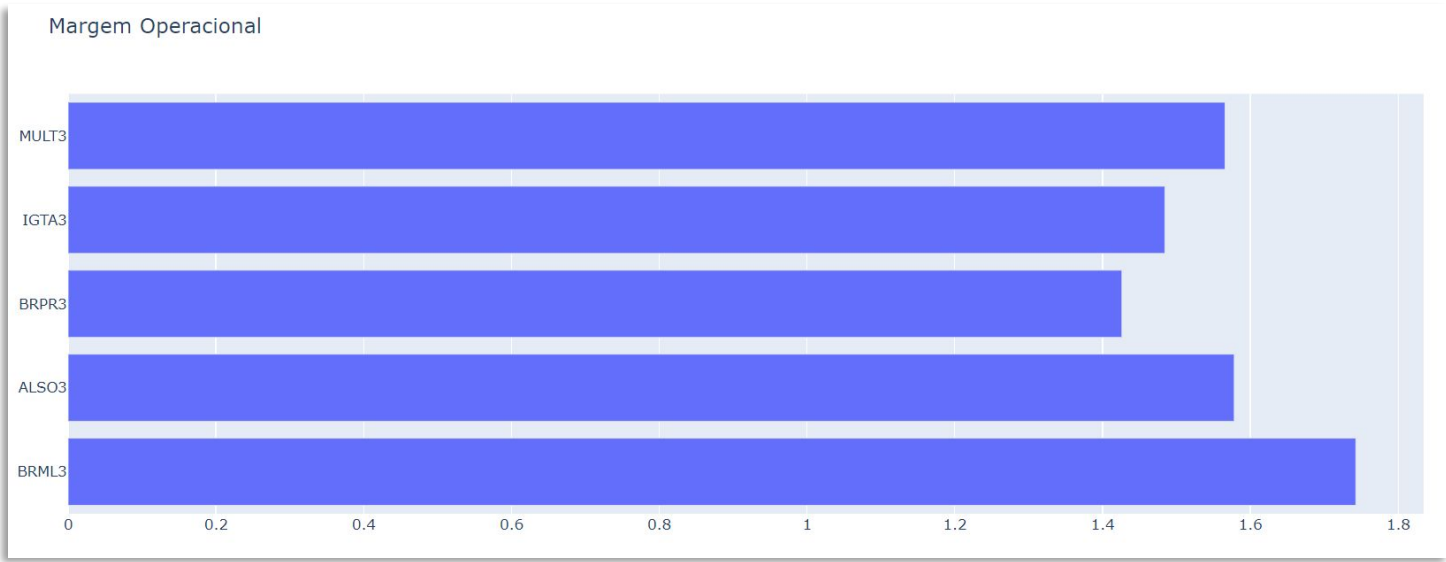
Por que utilizar?

Forma de reduzir os vieses humanos na tomada de decisão do mercado financeiro e tomar decisões mais embasadas. Além de melhorar o processo, permite automatizá-lo e dar mais eficiência ao trading.

Exemplos de utilização

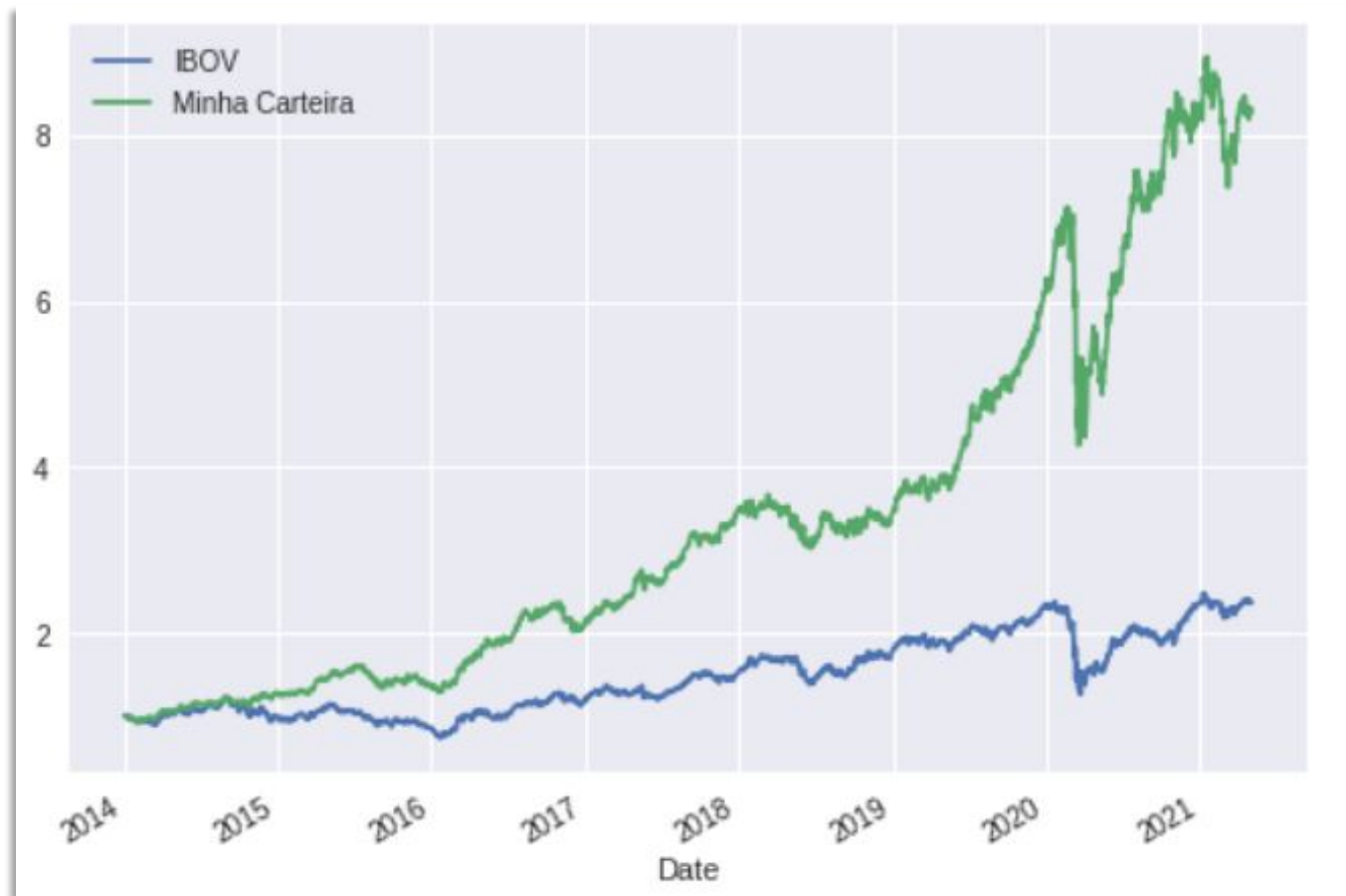


Análise técnica

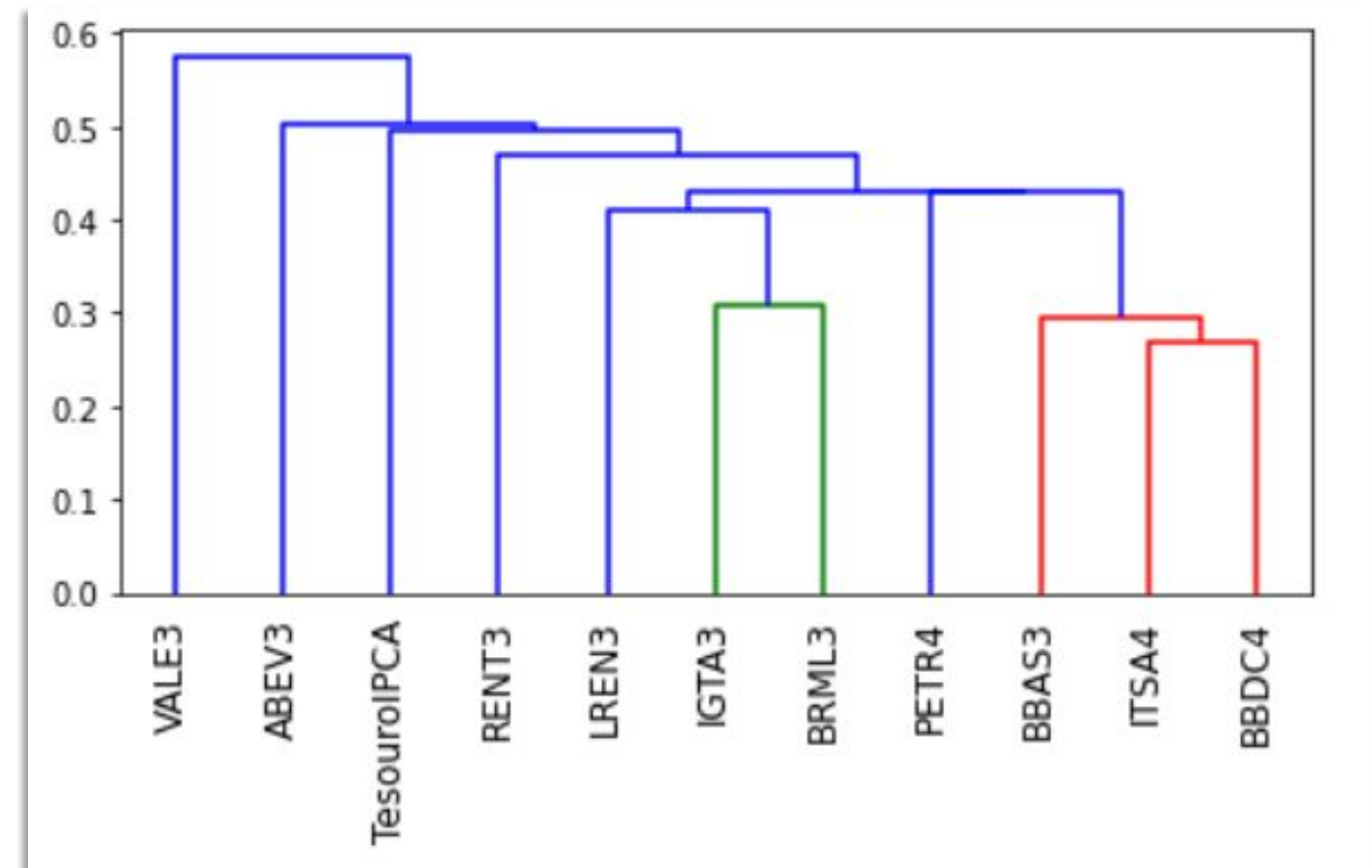


Análise fundamentalista

Exemplos de utilização



Backtesting e simulação de carteiras



Análise quantitativa

Bibliotecas de python

Manipulação de dados

pandas

numpy

Visualização de dados

seaborn

matplotlib

plotly

Obtenção de dados

pandasdatareader

yfinance

Alpha Vantage

Fundamentus

Análise técnica/backtest/trading

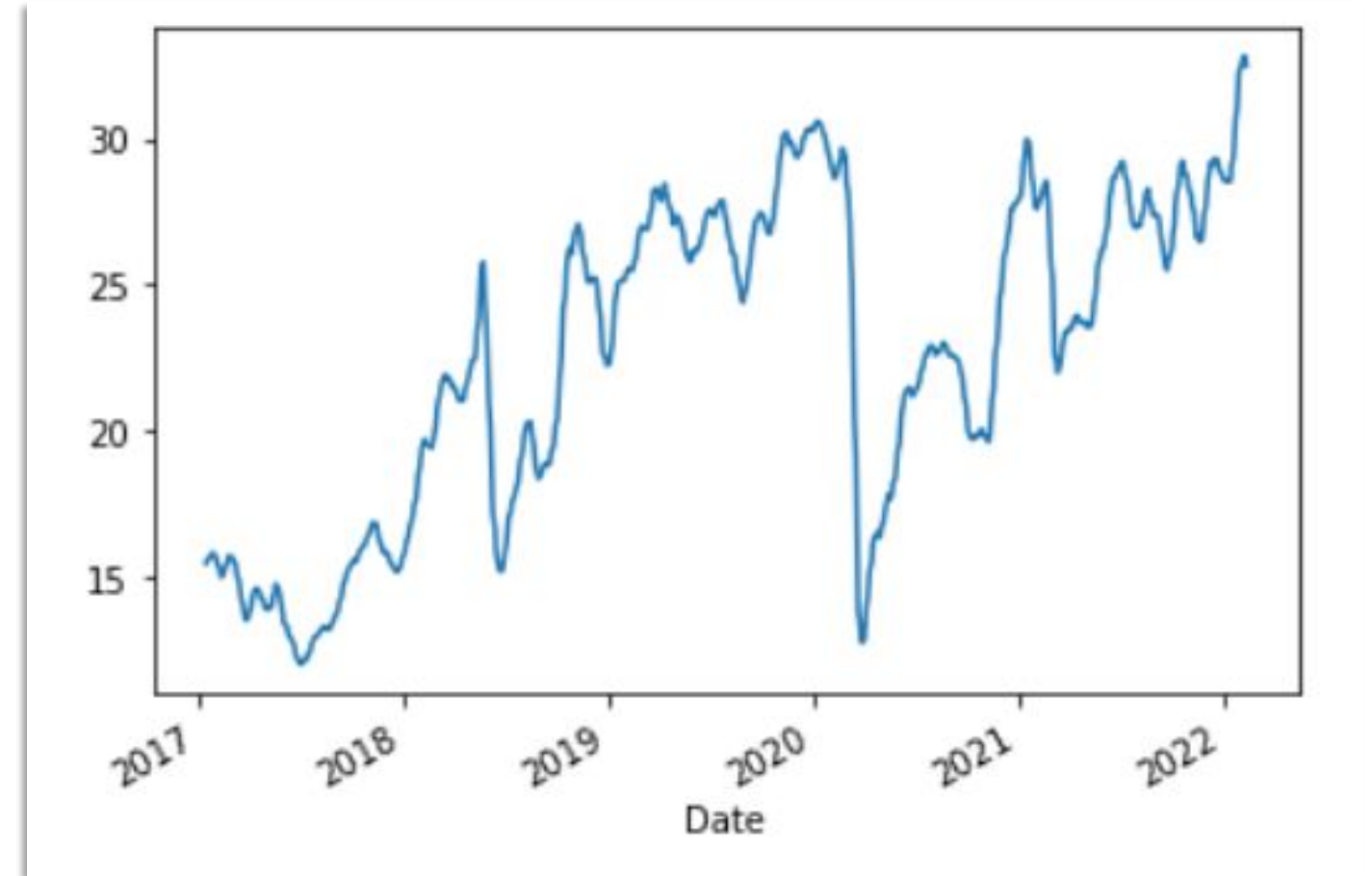
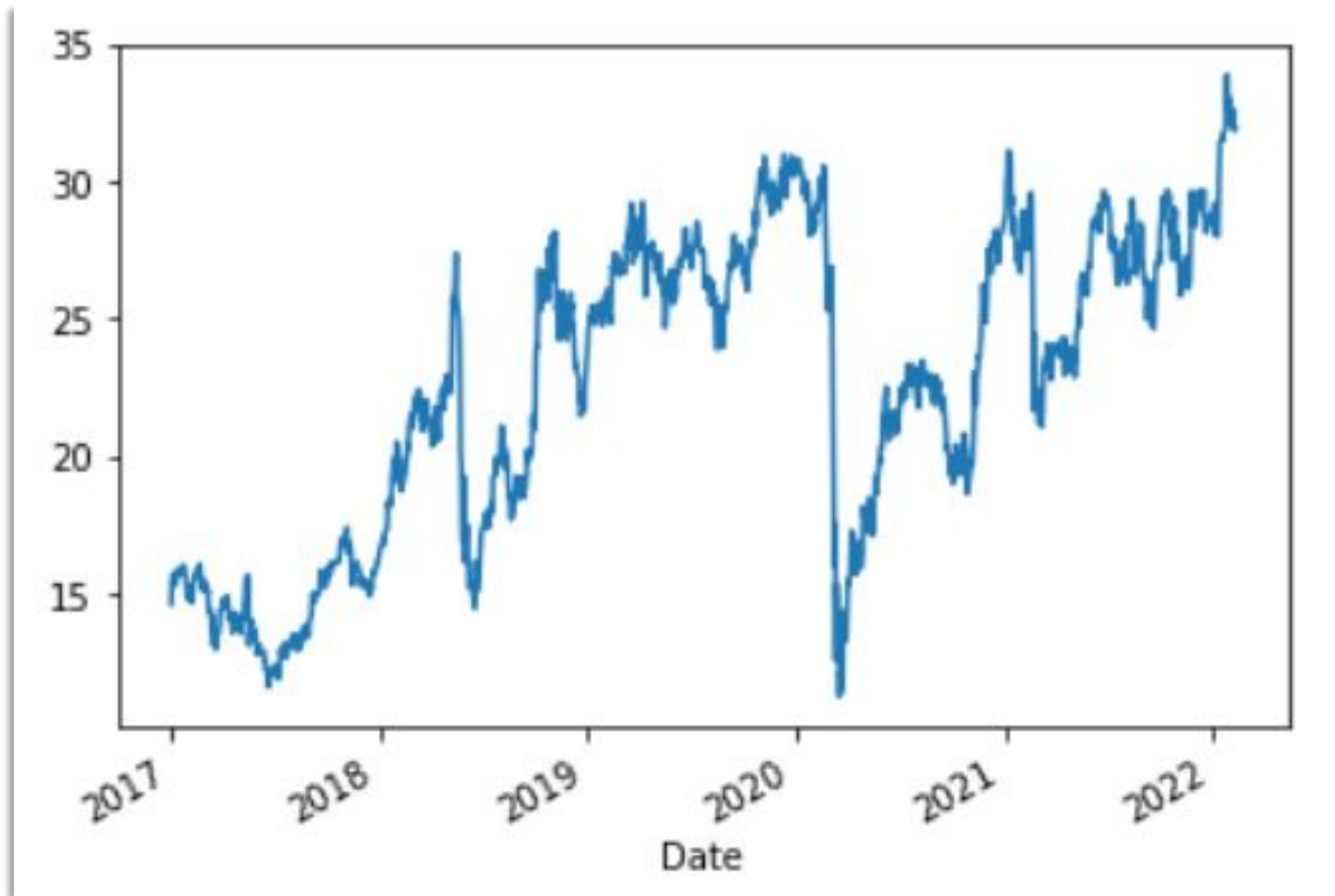
MetaTrader5

Backtrader

VectorBT

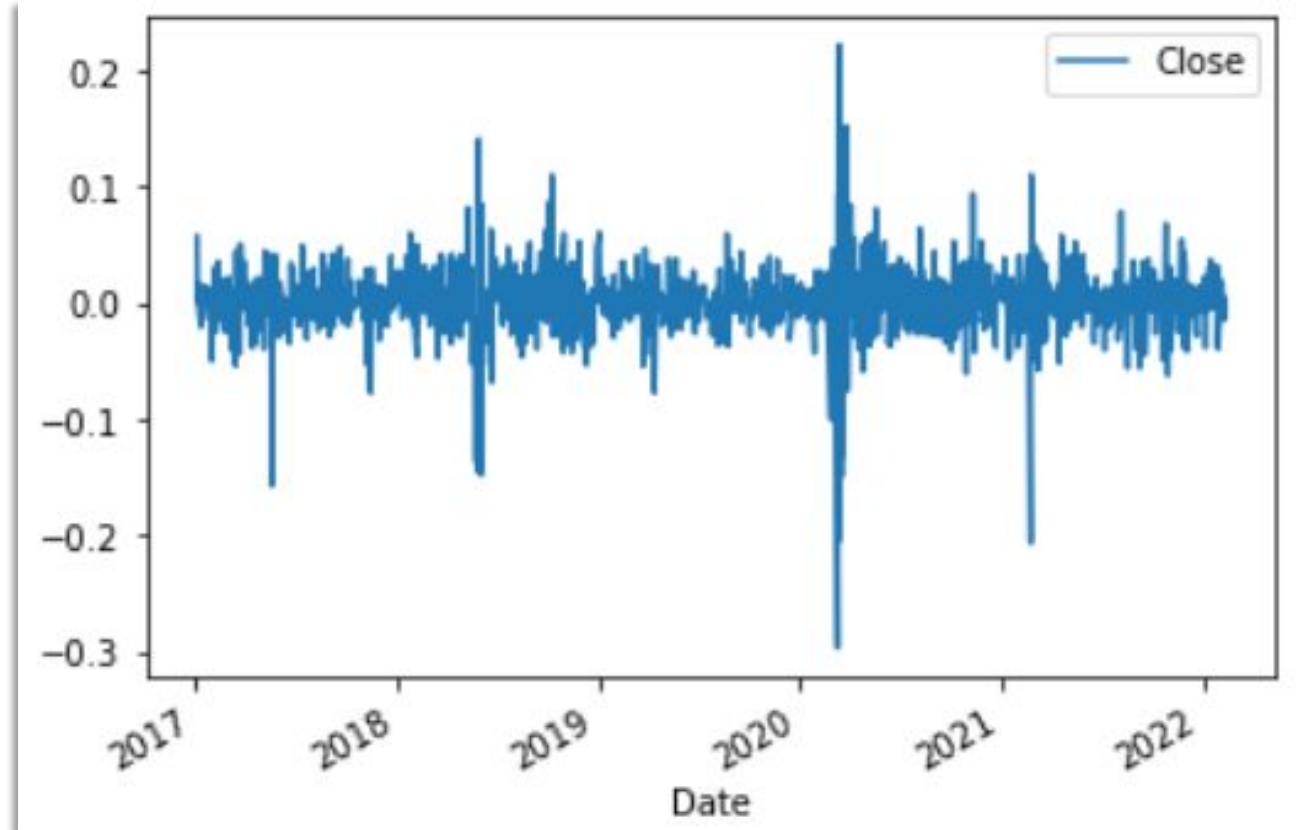
ta-lib

Conceitos fundamentais

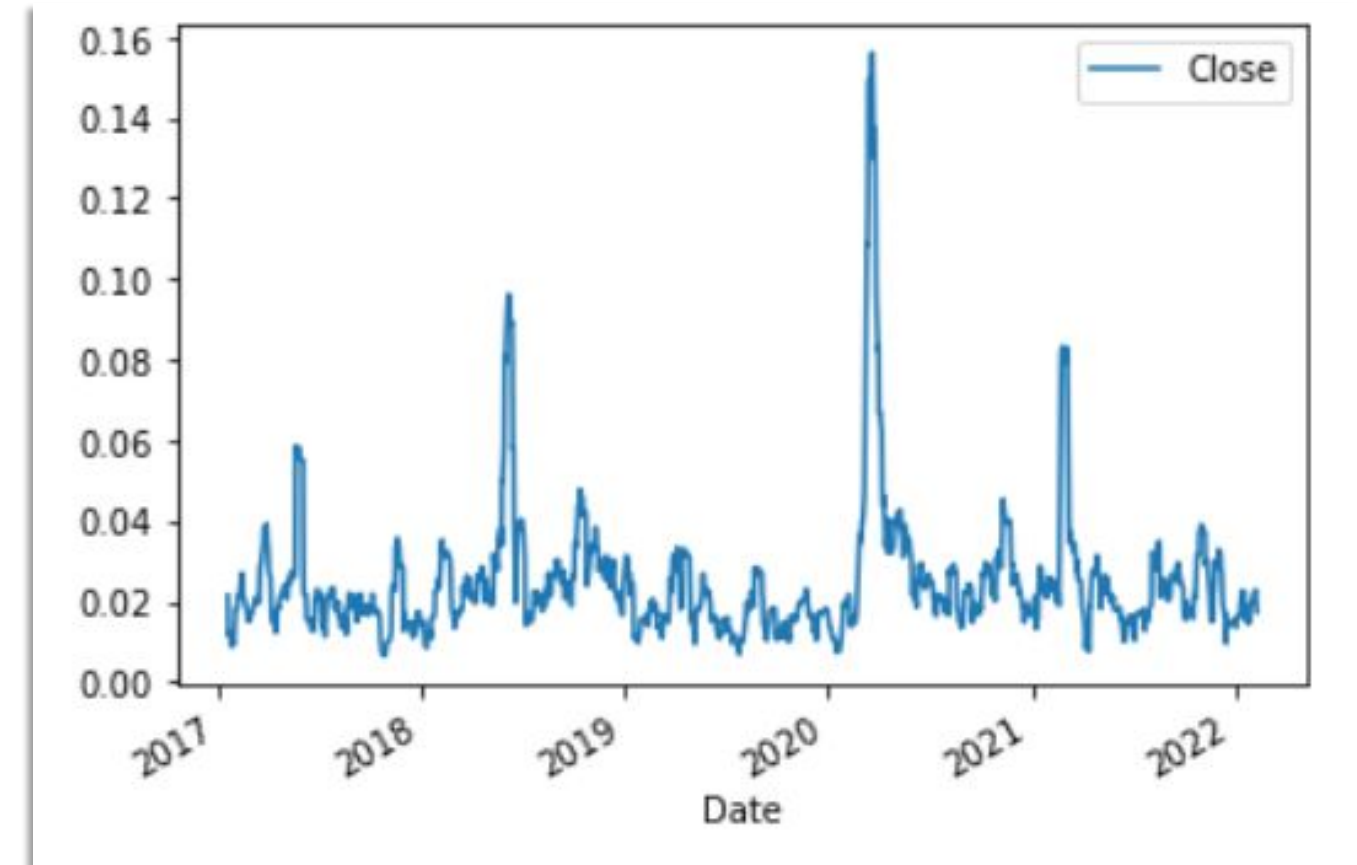


Médias móveis

Conceitos fundamentais

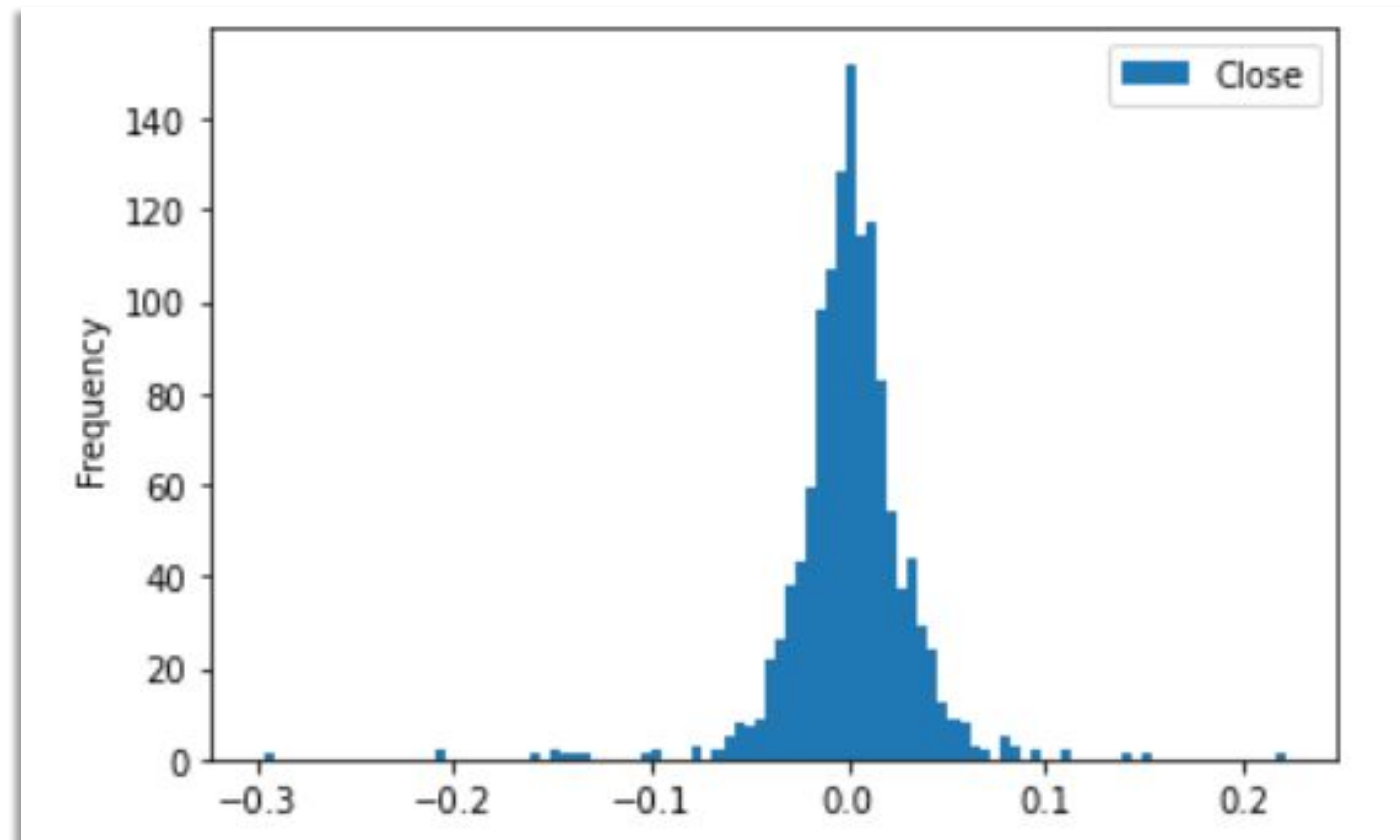


Retorno diário

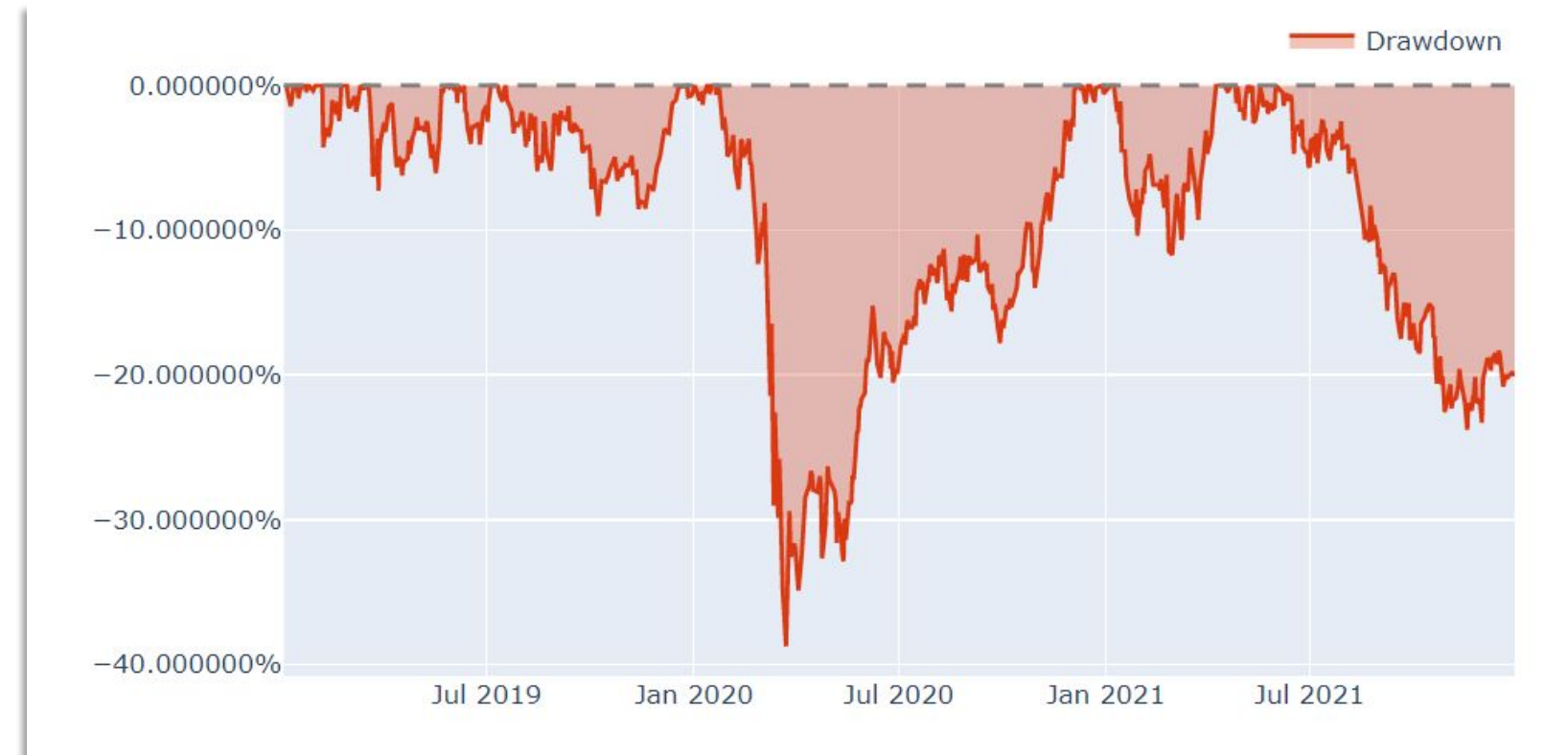


Janela de volatilidade

Conceitos fundamentais

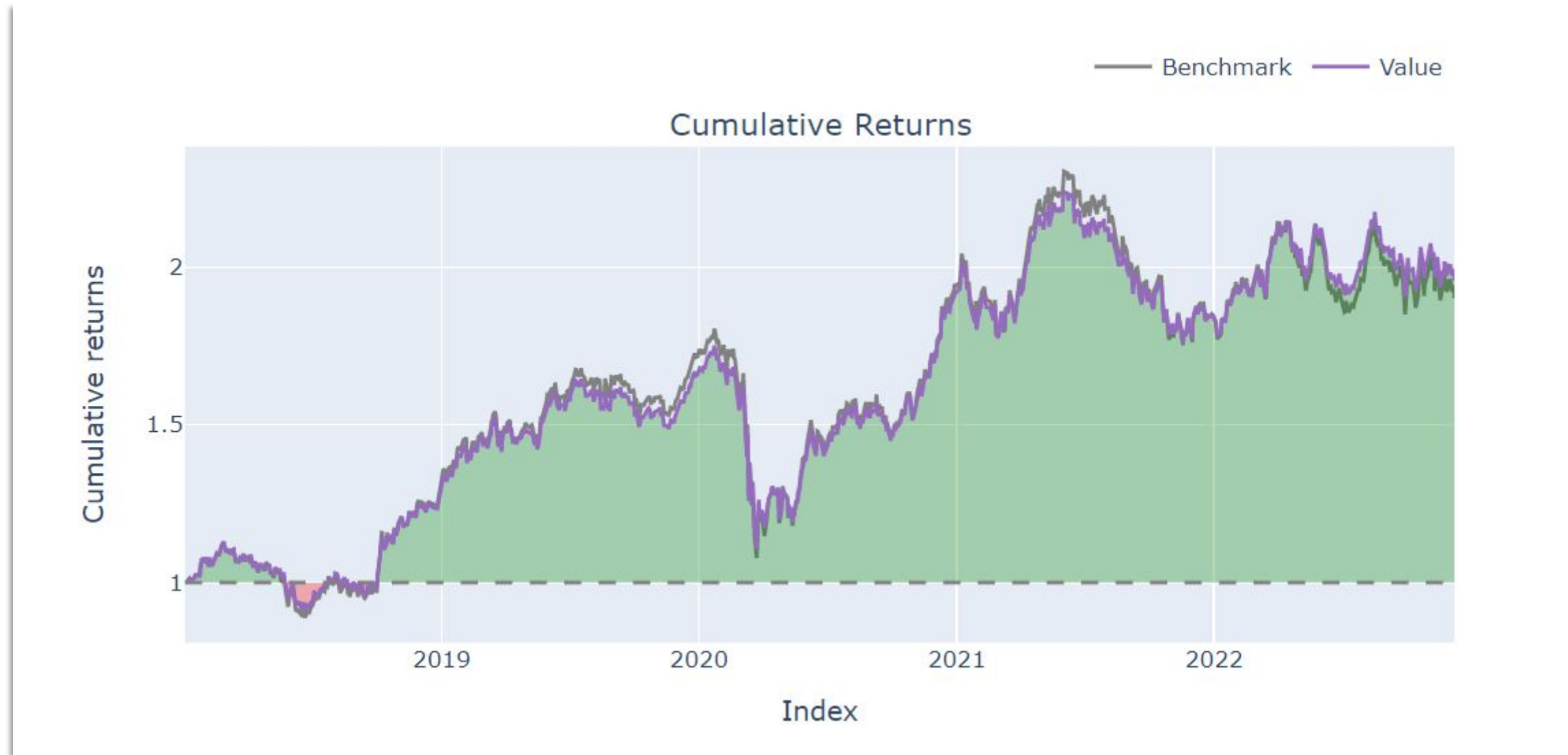


Distribuição dos retornos

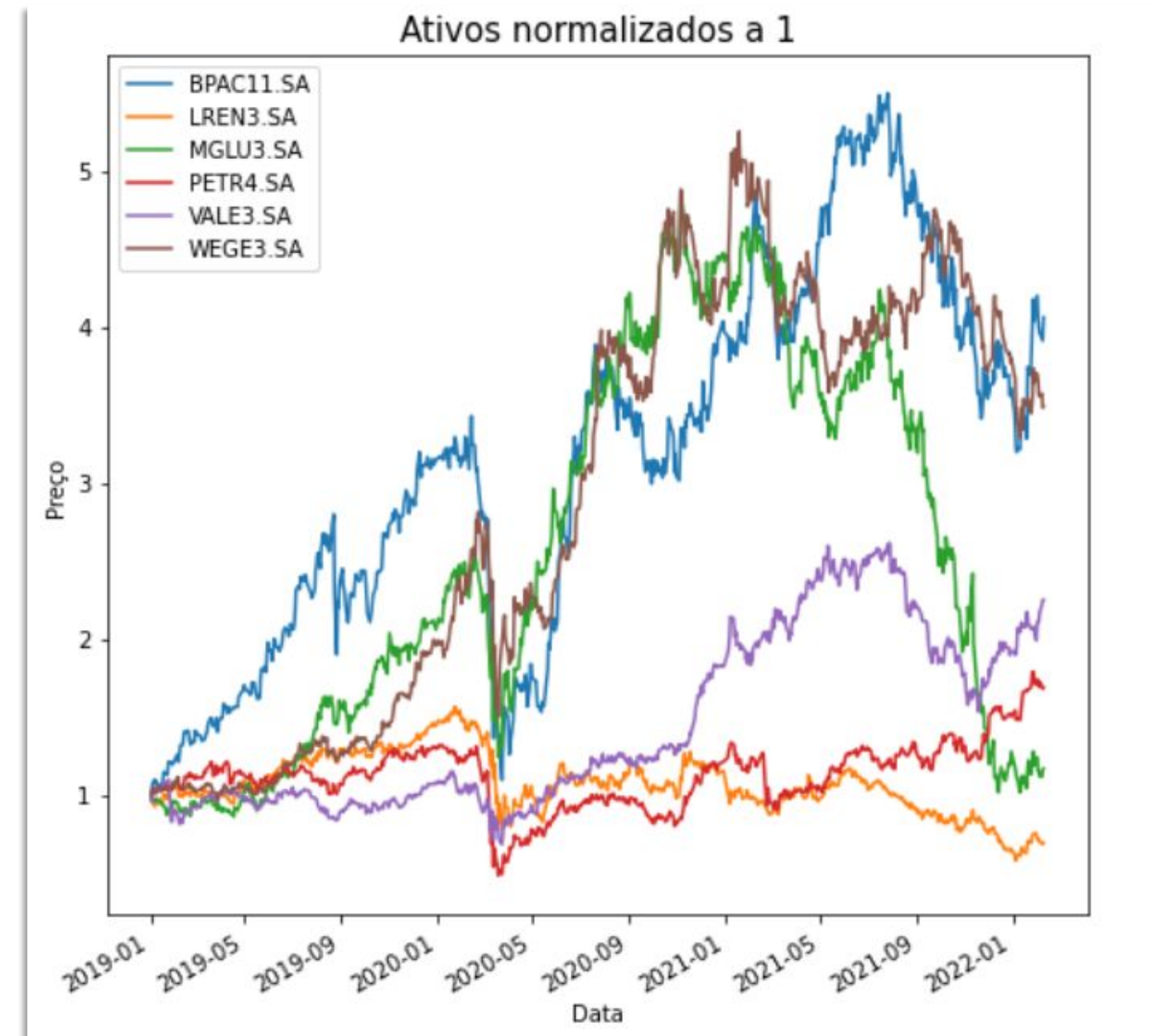
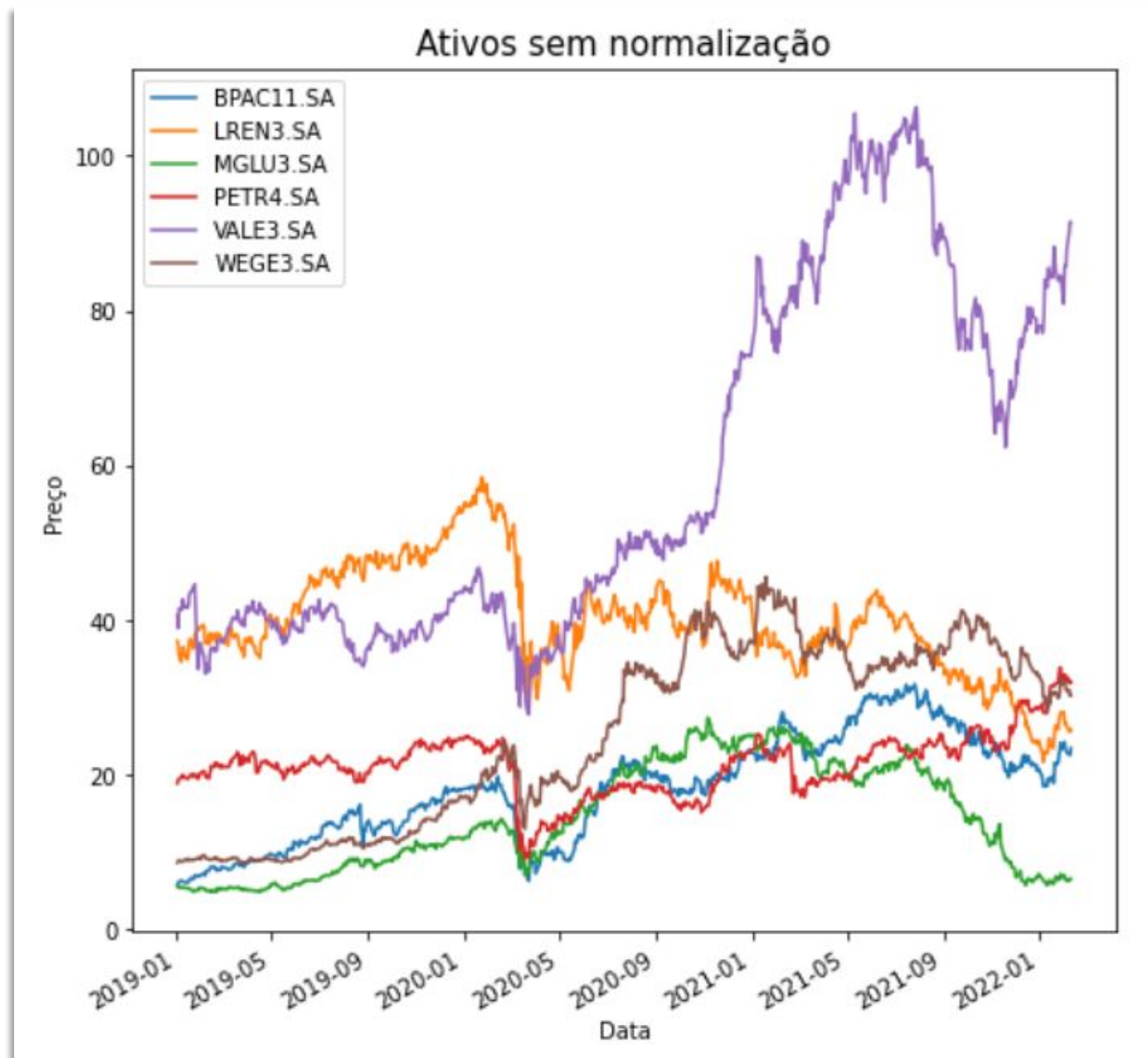


Drawdown

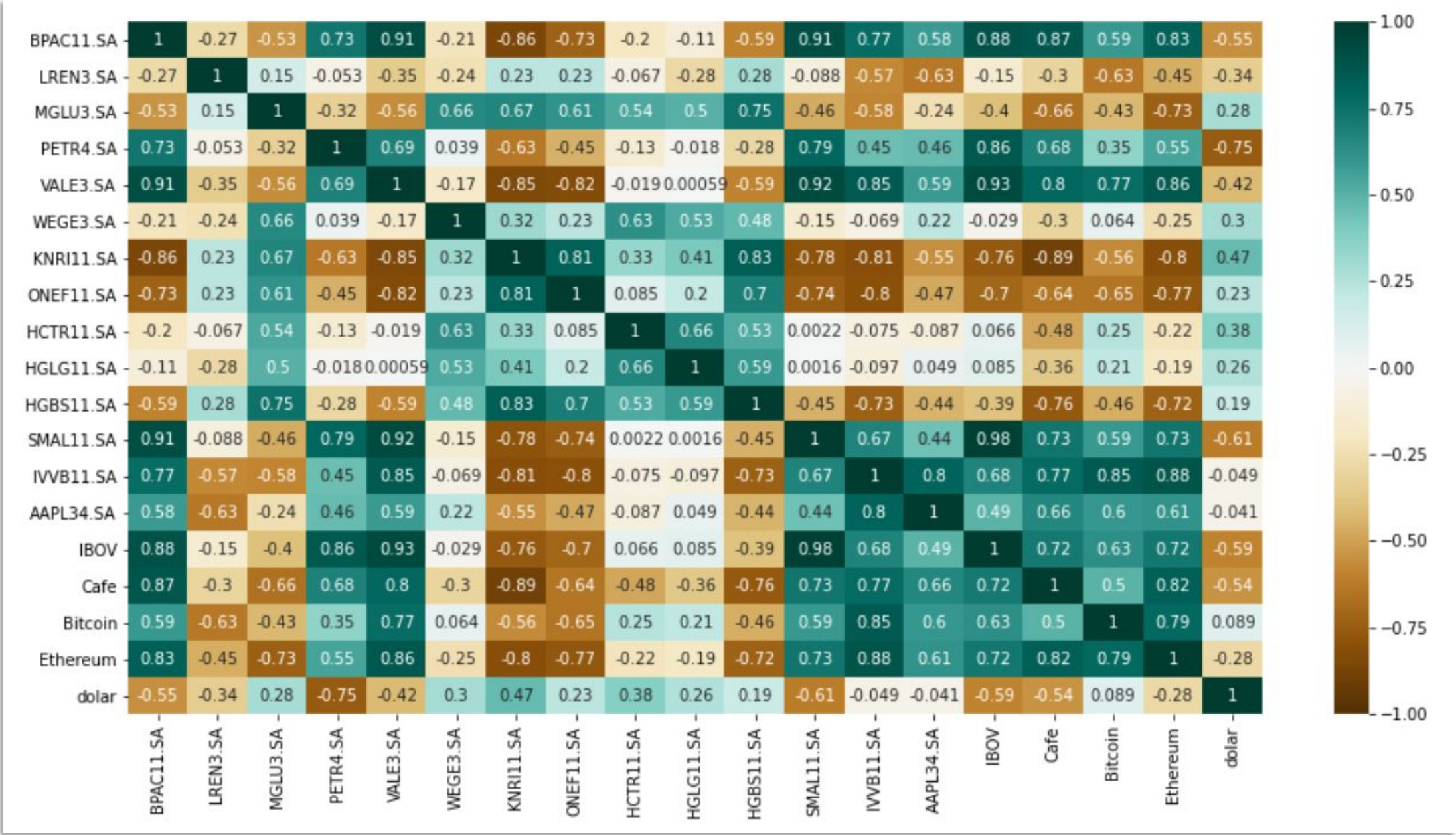
Conceitos fundamentais



Normalização



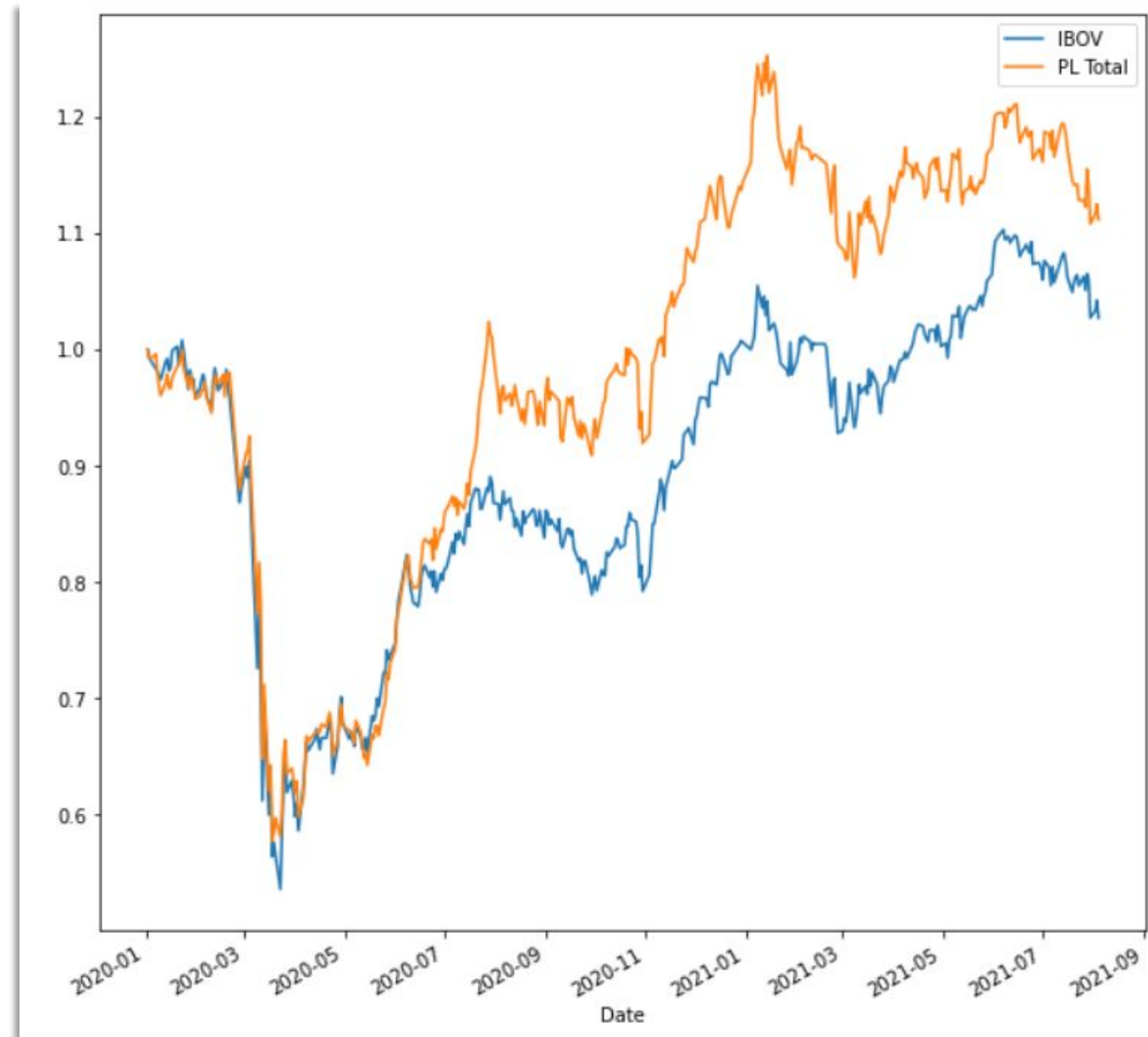
Correlação



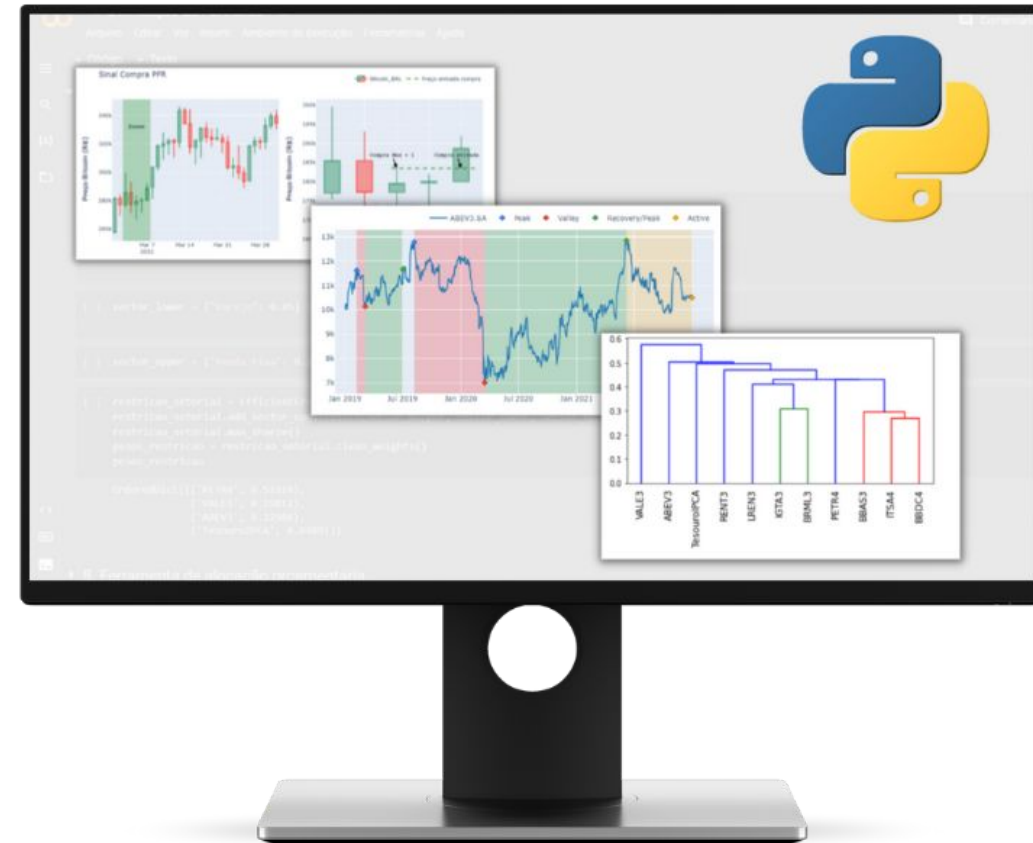
Simulação de carteiras

Nossa carteira fictícia:

PETR4
VALE3
ABEV3
WEGE3
EMBR3
RADL3
CVCB3
CIEL3
OIBR3
KNRI11



Mas antes disso...
O que são
estratégias?





Criação de estratégias

O que é uma estratégia de negociação?

É um plano estruturado para comprar e vender ativos de forma a gerar retornos lucrativos nos investimentos.

Deve ser objetiva, consistente, quantificável e verificável. A estratégia pode ser baseada em análise fundamentalista, técnica ou quantitativa, ou uma mistura delas. Ao construir uma estratégia, traders (e investidores de forma geral) devem formular objetivos claros do que pretendem atingir.

3543.68
254.879744
25314
3543.68
254.879744
25314
3543.68
254.879744
25314
3543.68
254.879744
25314
3543.68
254.879744
25314
3543.68
254.879744
25314
3543.68



