



stratsphera

Powered by BTG Pactual

O PORTAL BRASILEIRO DE ALGO TRADING

Jerckns Cruz
Caio Dottori

QUANT PELO MUNDO



Quantopian

kaggle



AUGUR



QUANTIACS



QUANTCONNECT

WORLDQUANT.

StockTwits®

Quandl

QUANTPEDIA



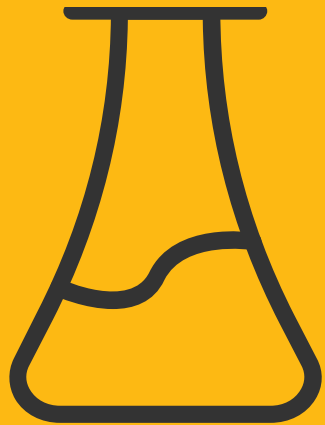
NUMERAI



stratsphera

MOTIVAÇÃO





BIBLIOTECA DE DADOS

'Alternative data': SEC enforcement risks grow

09/03/18 Henry Engler

'Alternative data': SEC enforcement risks grow as investors access potential non-public information Hedge funds and...

LEIA MAIS

BIBLIOTECA DE DADOS

Primeiro Conjunto de Dados Alternativos: Tweets

26/01/18 Jerckns Cruz

Podemos pensar em dados alternativos como aqueles que se apresentam de maneira desestruturada e são...

LEIA MAIS

Tutoriais

Começando Agora (1 cursos)

Conceitos Gerais (7 cursos)

Conceitos Matemáticos (10 cursos)

Medidas de Tendência Central (em breve)

Covariância, Correlação e Regressão (em breve)

Momentos Estatísticos (em breve)

Distribuição de Probabilidade

Estimadores de Máxima Verossimil

Intervalos de Confiança e Teste de

Análise dos Resíduos (em breve)

Fórum

Mais novos Mais relevantes

Score e custos já estão di

fepshampshire 9 dias atrás

Equipe stratsphera Campeonatos

Margem Short

andrelorenzo 13 dias atrás

Simulador Dúvidas

Eventos Corporativos, ma

andrelorenzo 15 dias atrás

Simulador Dúvidas

Dicas úteis para postagen

fepshampshire 18 dias atrás

Equipe stratsphera Tutoriais Dúvidas

Estratégias Sistemáticas

jerckns.cruz 18 dias atrás

Equipe stratsphera Blog

Moving Average

Manuseio X Add category

```

1 from dorothe import StrategyBase
2 from finmath import TA
3
4
5 class Strategy(StrategyBase):
6     def on_init(self, settings):
7
8         settings.risk.allow_bankrupt = True
9
10        self.symbol = 'CMIG4' # Ticker string
11
12        self.slow_period = 30
13        self.fast_period = 15
14        self.slow_SMA = TA.sma(self.slow_period)
15        self.fast_SMA = TA.sma(self.fast_period)
16        self.last_slow_price = None
17        self.last_fast_price = None
18        self.price = None
19
20        self.data.get.hist.bar_close
21
22        lookback_slow_period = self.data.get.hist.bar_close(self.symbol, length=
23
24        for index, row in lookback_slow_period.iterrows():
25            self.slow_SMA.add(row['Close'])
26
27        for index, row in lookback_slow_period.tail(self.fast_period).iterrows():
28            self.fast_SMA.add(row['Close'])
29
30        settings.general.benchmark = 'CDI' # Benchmark
31
32        self.instrument = self.data.subscribe.bar_close(self.symbol) # Subscribe
33
34        def on_bar_close(self, bar):
35            self.price = bar.close # Update price
36

```

De 2017-02-13 a 2018-02-08 R\$ 1.000.000,00

Sharpe	Sortino	Accumulated return	Volatility	Max drawdown
1.26	2.43	2736%	35.46%	-32.01%

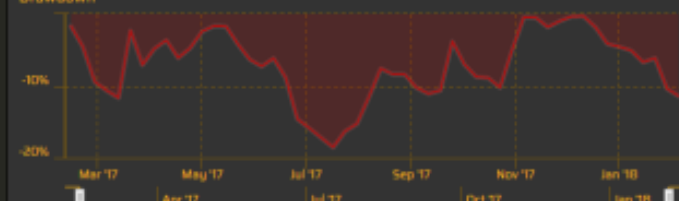
Accumulated Return



Return



Drawdown



🔍 ⚠️ 🛑

STATISTICS

MACHINE LEARNING

PREDICTION

NEWS SENTIMENT

ARTIFICIAL INTELLIGENCE

NLP

CHART ANALYSIS

HIGH FREQUENCY

FUNDAMENTALS

SOCIAL MEDIA

QUANTITATIVE TOOLS

MUITO OBRIGADO!

jcruz@stratsphera.com
cdottori@stratsphera.com



stratsphera

Powered by BTG Pactual