

O Programa de Pós-Graduação em Estatística convida para:

WEBINAR

Um sistema de negociação automatizado baseado no modelo GARCH

Palestrante:

Prof. José Augusto Fiorucci (EST/UnB)

DATA: 10/12/2020 (quinta-feira)

HORÁRIO: 14:00h (horário local de Brasília)

O seminário é público e poderá ser assistido pelo Link
<https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19>.

Resumo

O sistema de negociação conhecido como RTS (Reaction Trend System) foi proposto em um dos livros mais famosos de análise técnica (Wilder, 1978). Esse sistema se destaca dos demais por alternar automaticamente entre duas estratégias, uma para cenários com tendência (Trend System) e outra para cenários lateralizados (Reaction System). Nesta apresentação será abordado o sistema RTS, bem como recentes pesquisas para melhorar o desempenho e a estabilidade através da modelagem estatística da volatilidade de ativos financeiros. Os sistemas serão ilustrados através da execução em tempo passado (backtest) de um robô de investimentos na plataforma Meta-Trader 5.

