

ESTUDO SOBRE O DESEMPENHO DE INVESTIMENTOS NO MINI ÍNDICE COM BASE EM MÉDIAS MÓVEIS

Emeson de Sousa Lima Filho, Francisco Gildemir Ferreira da Silva

O uso de programas computacionais e de linguagens de programação traz uma grande vantagem produtiva para profissionais da área de negócios, pois elas permitem que os profissionais façam suas atividades de forma mais rápida e em larga escala, nesse caso vai ser muito importante a precisão que se ganha com o uso da tecnologia pois vai ser gerado simulações e otimizações no algoritmo. Este trabalho além de apresentar um estudo sobre a estratégia de médias móveis também se preocupa em explanar sobre os modos de uso da plataforma MT5 (Metatrader 5) e da sua linguagem, o MQL5. O MQL5 é útil quando se trata de análise técnica pois permite a análise de preços e a realização de cálculos em tempo real, o que possibilita o estudo preciso de diversas estratégias, nesse caso, o foco é o estudo das médias móveis. Média móvel é um indicador técnico que busca mostrar a tendência de preço de um ativo, existem vários tipos de médias móveis, tais como: simples, exponencial, suavizada e a linear-ponderada. Todas serão usadas nas simulações. Sendo assim, serão feitas simulações para ver como teria sido o desempenho financeiro da estratégia em questão dentro do período especificado. Uma vez que as médias móveis têm como objetivo antecipar tendências de mercado, é correto afirmar que os tipos e períodos mais interessantes de se usar são aqueles que antecipam melhor essas tendências. Com base na bateria de testes, ficou claro que a estratégia que se saiu melhor antecipando tendências foi a que usou o tipo de média suavizada de 11 períodos, como rápida e a simples de 80 períodos como média lenta, com um período gráfico de 4 minutos. Os experimentos que serão feitos no futuro visam colocar mais variáveis nos testes em questão, como horários de operação e métodos de gerenciamento de riscos mais eficientes, além disso, fazer os testes com médias móveis em outros ativos, como por exemplo em ações e derivativos.

Palavras-chave: Médias Móveis. Simulações. Metatrader 5. MQL5.