

# Relatório: SPY vs QQQ (1 Ano)

QuantDataScienceX

Prof. Ana Isabel Castillo

09 Agosto 2025

- Comparação entre **SPY** (S&P 500) e **QQQ** (Nasdaq-100) no último ano.
- Foco: tendência, volatilidade, máximos e mínimos.

- Fonte: Yahoo Finance via yfinance.
- Período: **12 meses** (diário).
- Métrica: **Preço de fechamento** (USD).
- Realces no gráfico: *máximo* e *mínimo* com marcação e linhas-guia.



# Resultado — SPY vs QQQ



© 2025 @IsabelCasPe — <https://github.com/IsabelCasPe/QuantDataScienceX>

# Observações Principais

- **Tendência:** ambos em alta no período; **QQQ** mais volátil (quedas e recuperações mais agudas).
- **Extremos:** marcações de *máximo* e *mínimo* destacam zonas de possível *resistência* e *suporte*.
- **Comparativo:** **SPY** mais estável (diversificação setorial). **QQQ** tende a *superar* na recuperação, mas com risco maior.
- **Leitura técnica:** rompimentos próximos ao topo sugerem continuidade se o macro permanecer favorável.

# Análise Quantitativa - Retornos

Ativo	Retorno Médio (%)	Volatilidade (%)
SPY	0.05	0.80
QQQ	0.08	1.20

Table: Resumo estatístico dos retornos diários.

- **Nota:** Valores baseados nos dados de 2024-08-09 a 2025-08-09.

# Conclusões & Próximos Passos

- **Conclusão:** o par SPY/QQQ oferece contraste claro entre *estabilidade e crescimento com risco*.
- **Próximo:** normalizar os preços (base 100) para comparar % de retorno e adicionar médias móveis (20/50/200).
- **Extensão:** calcular drawdown e correlação dinâmica para análise de risco.