

Design Robô

Nome do Robô

Explicação Nome

Explicação Lógica Estratégia

Tipo de Estratégia

Classe de Ativos

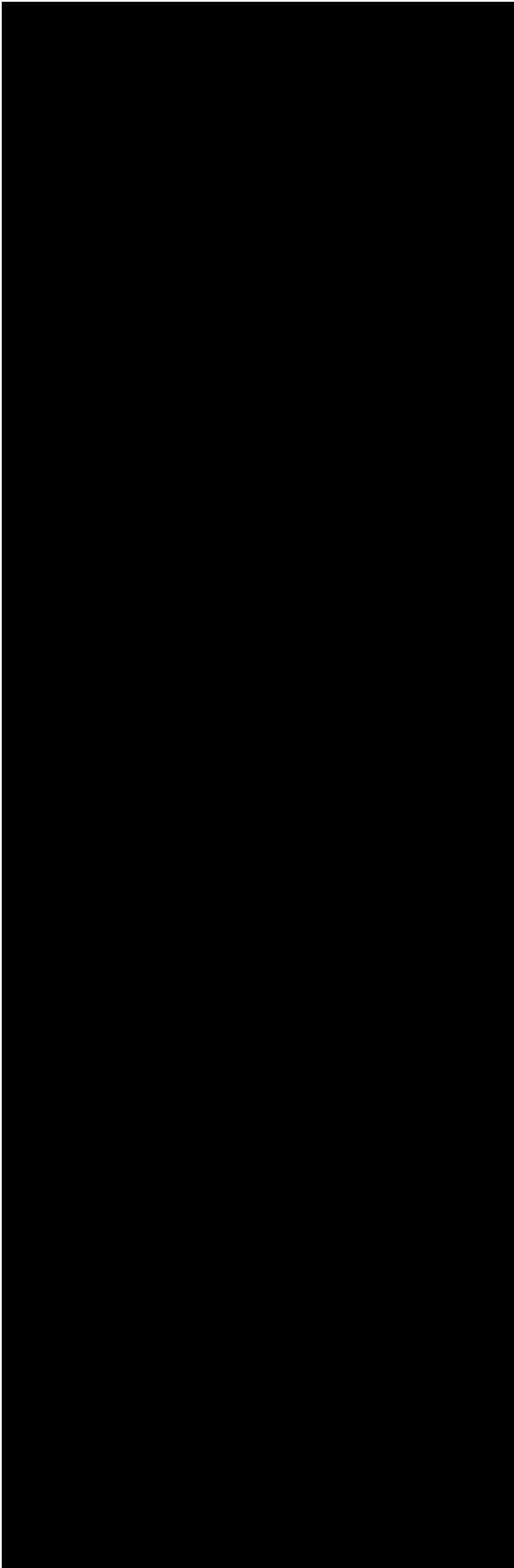
Universo

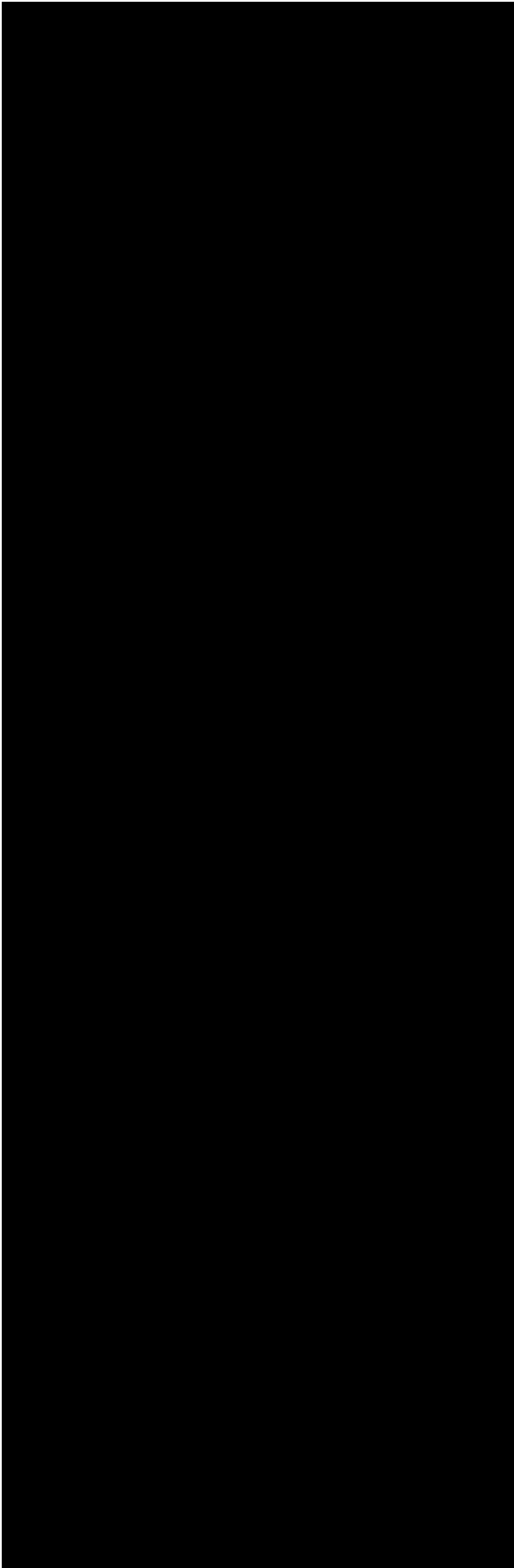
Média Trades por mês

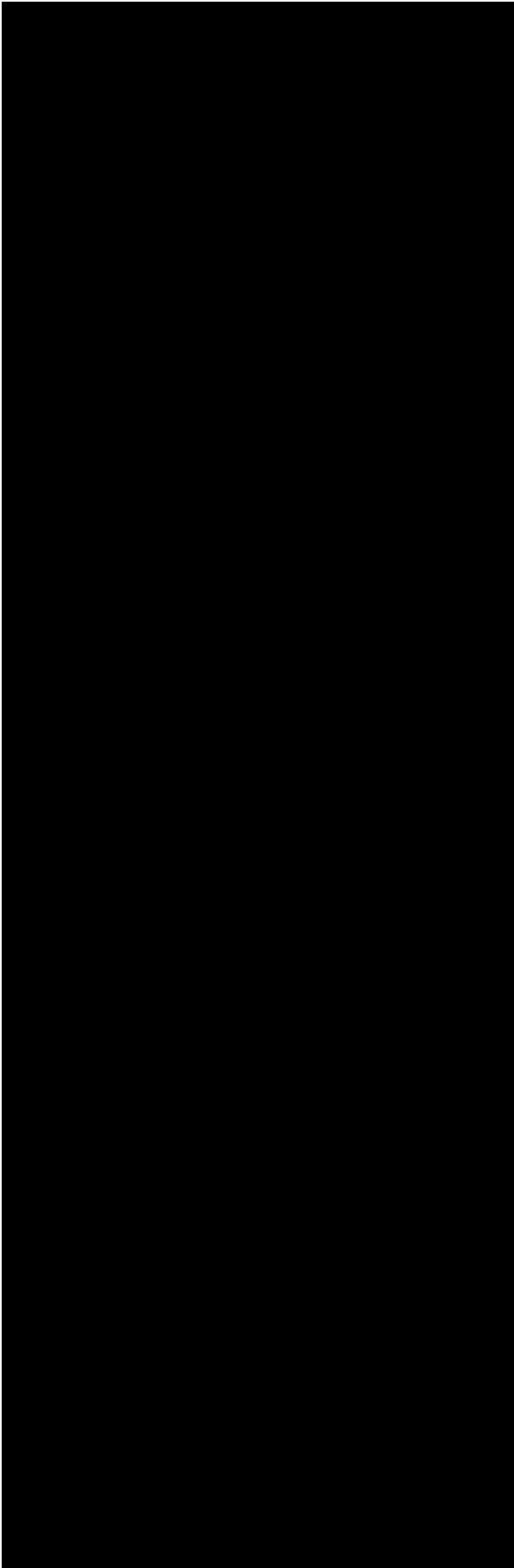
Holding Period

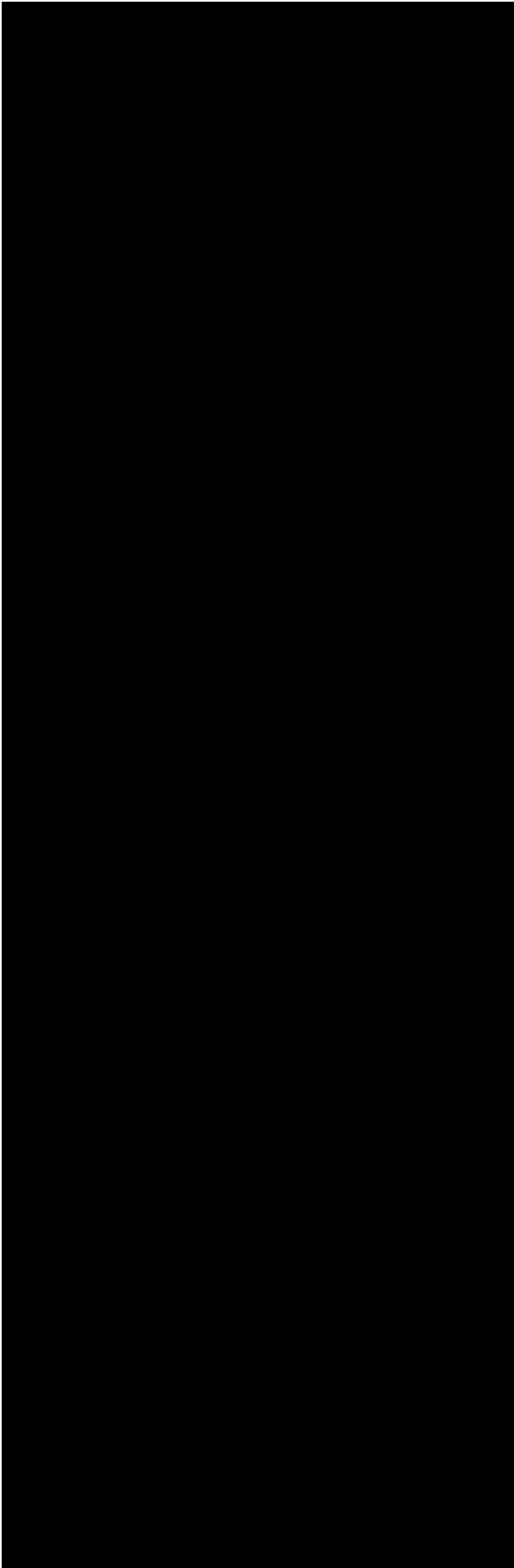
Qual Plataforma Testou a estratégia

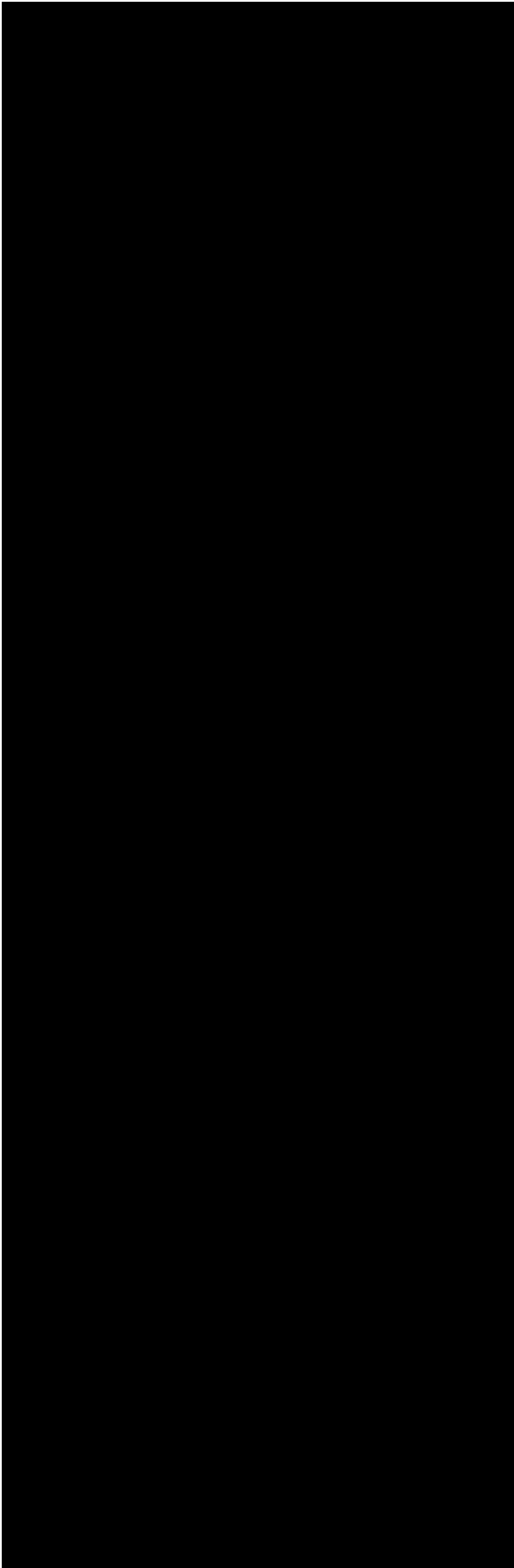
Benchmark Estratégia:

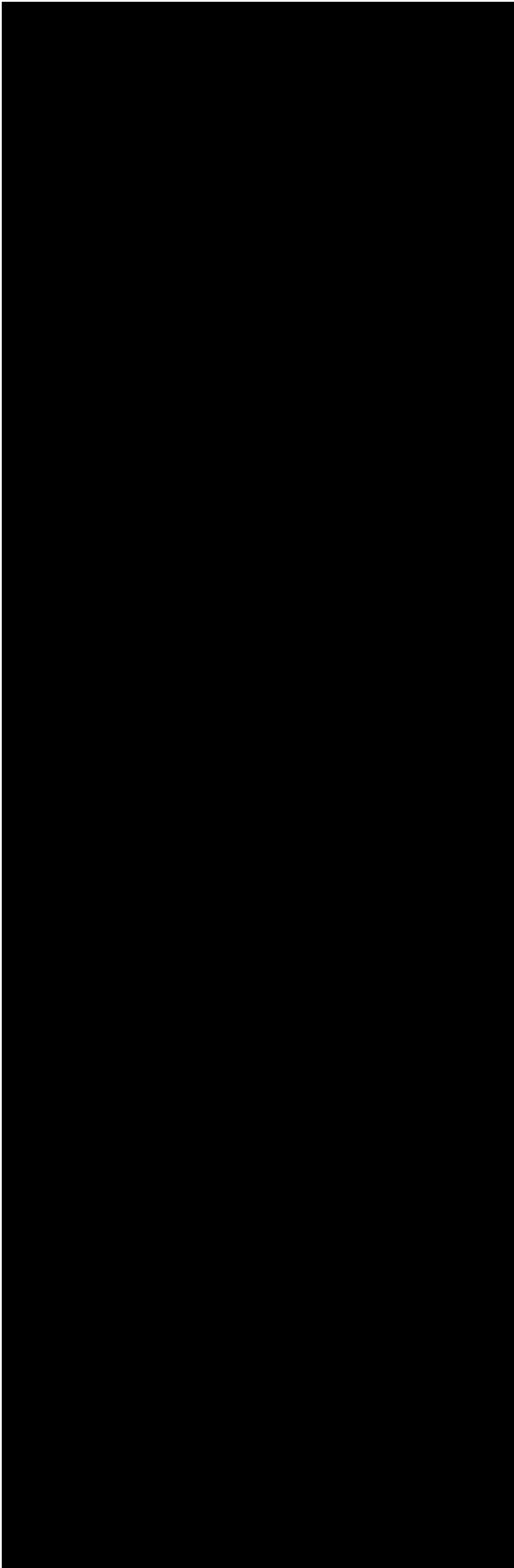


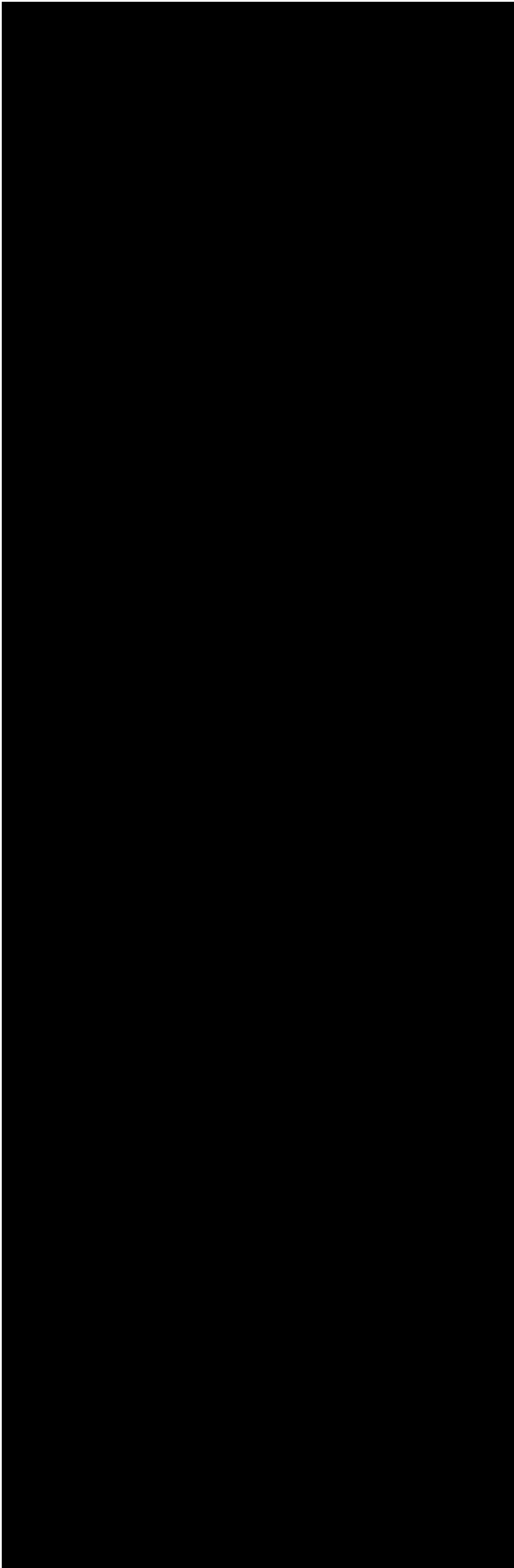


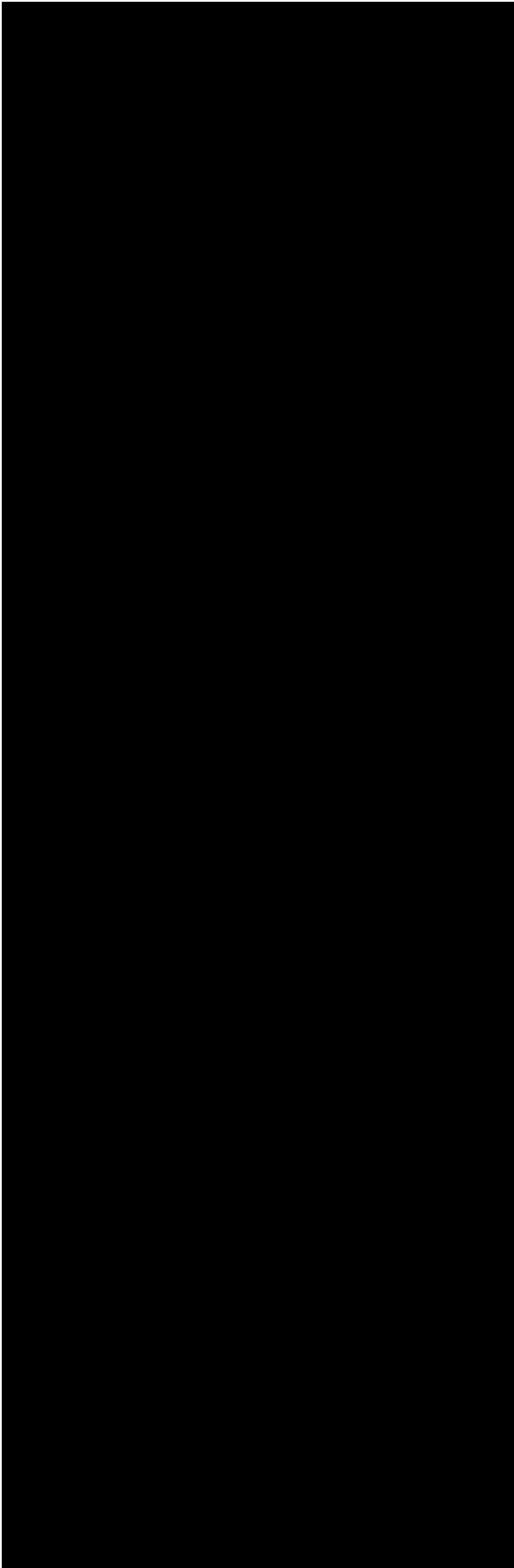


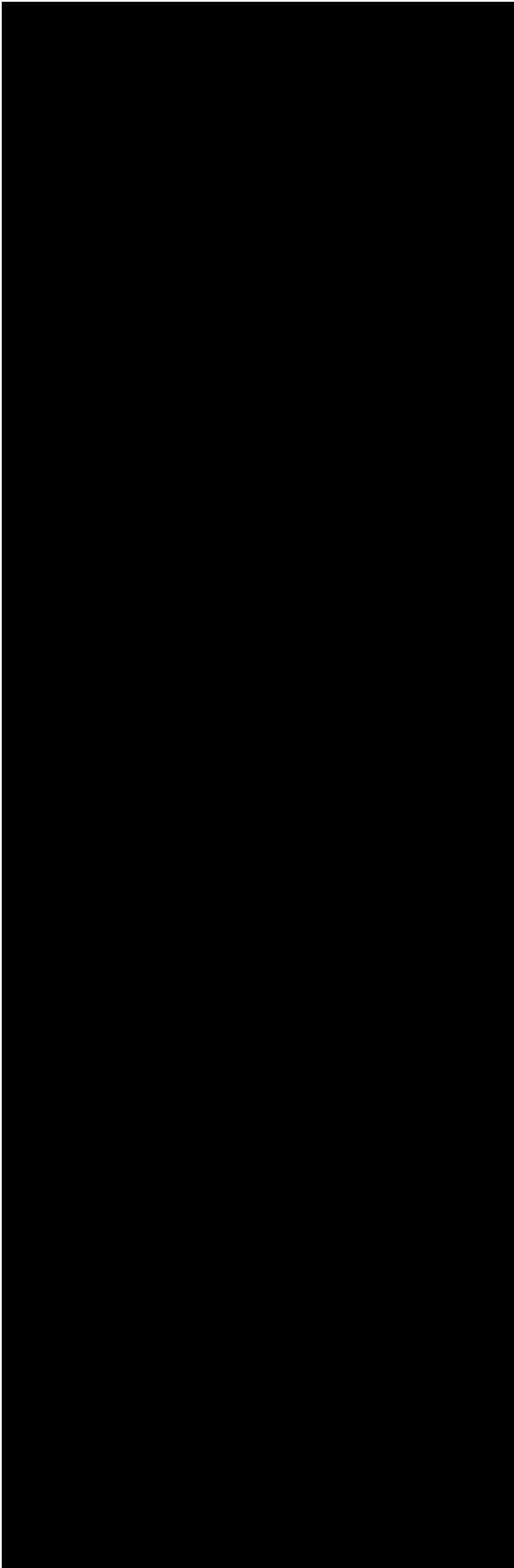


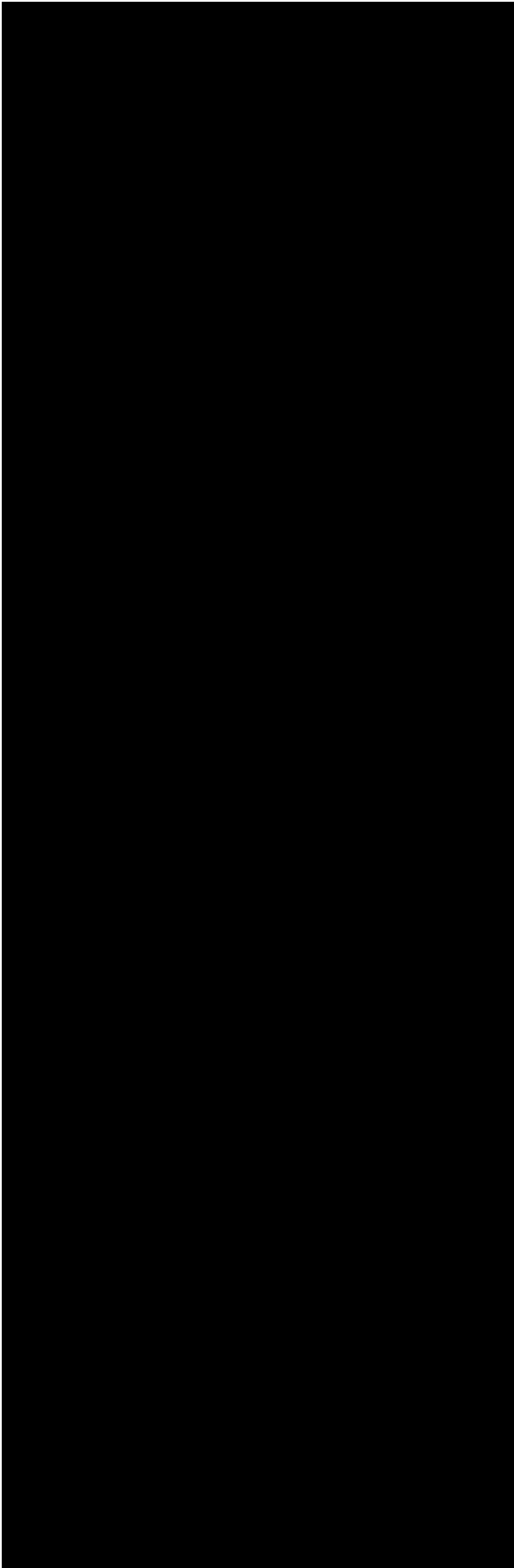


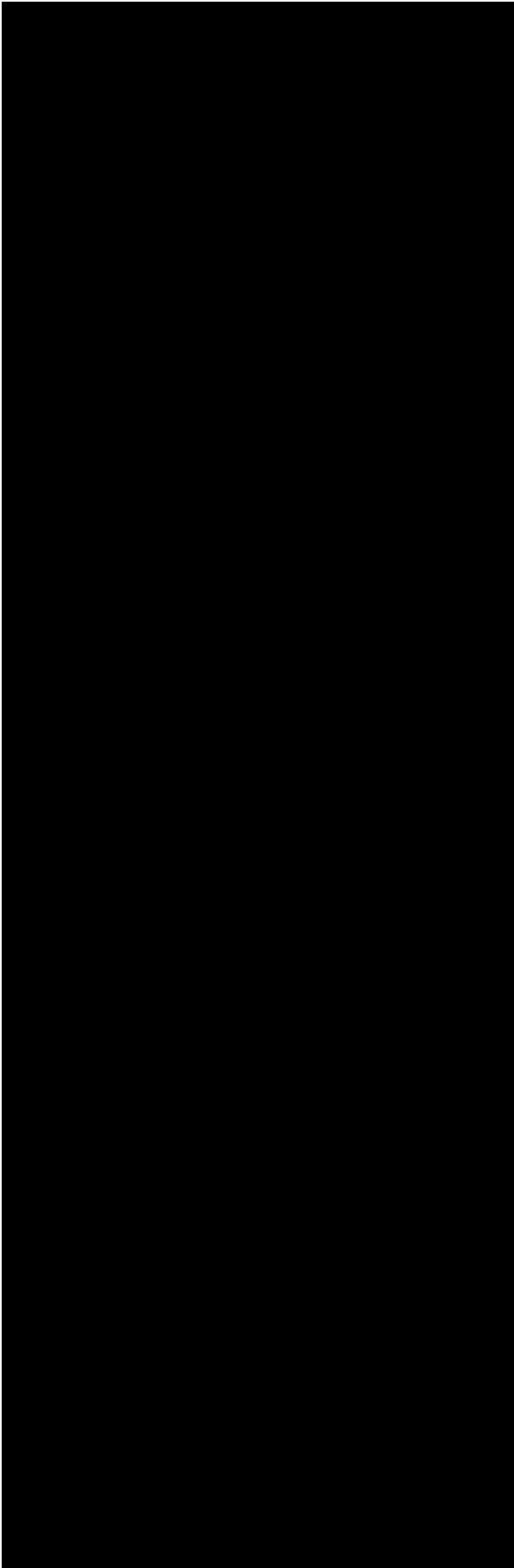


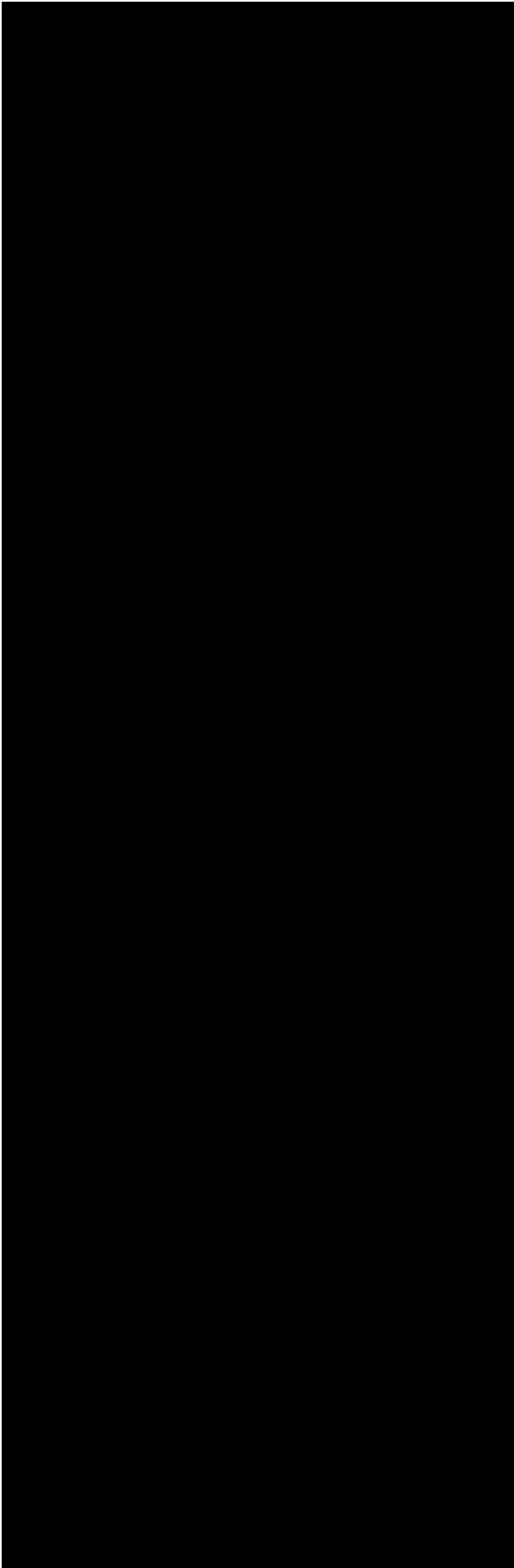


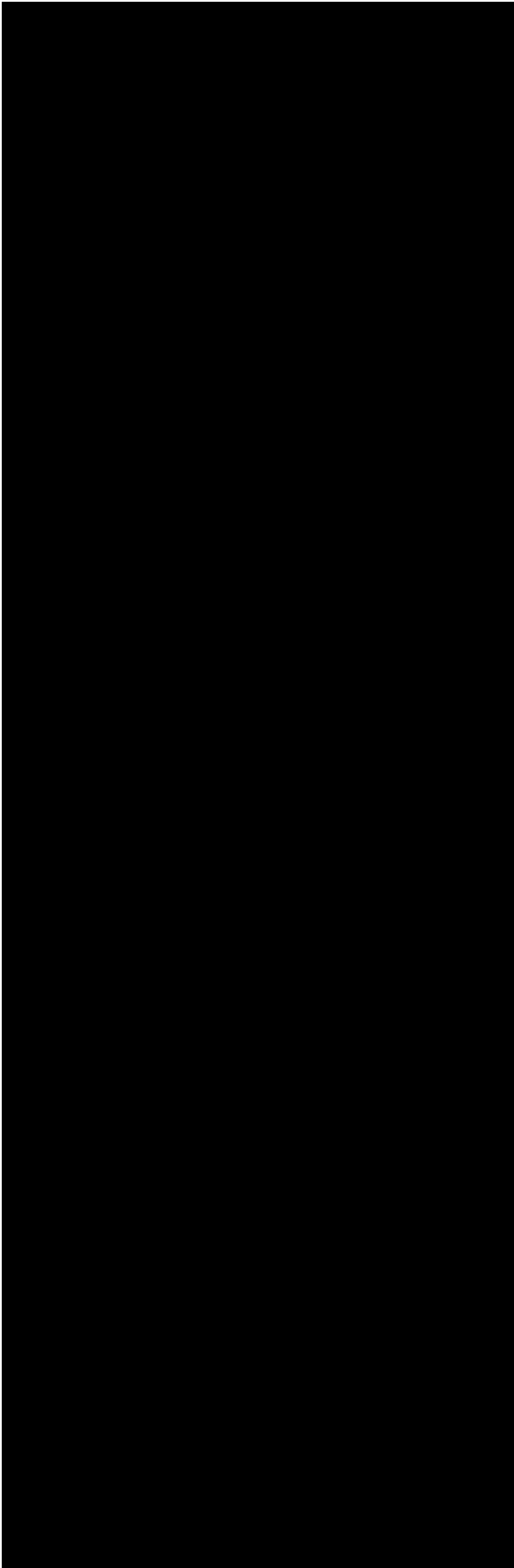


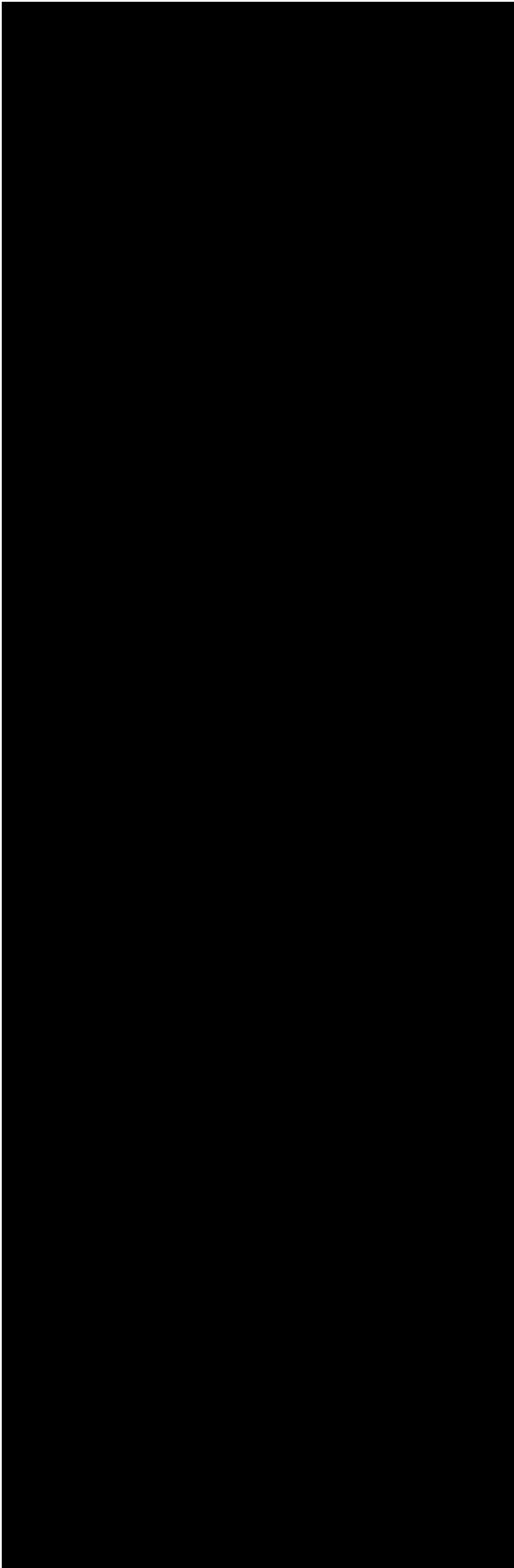


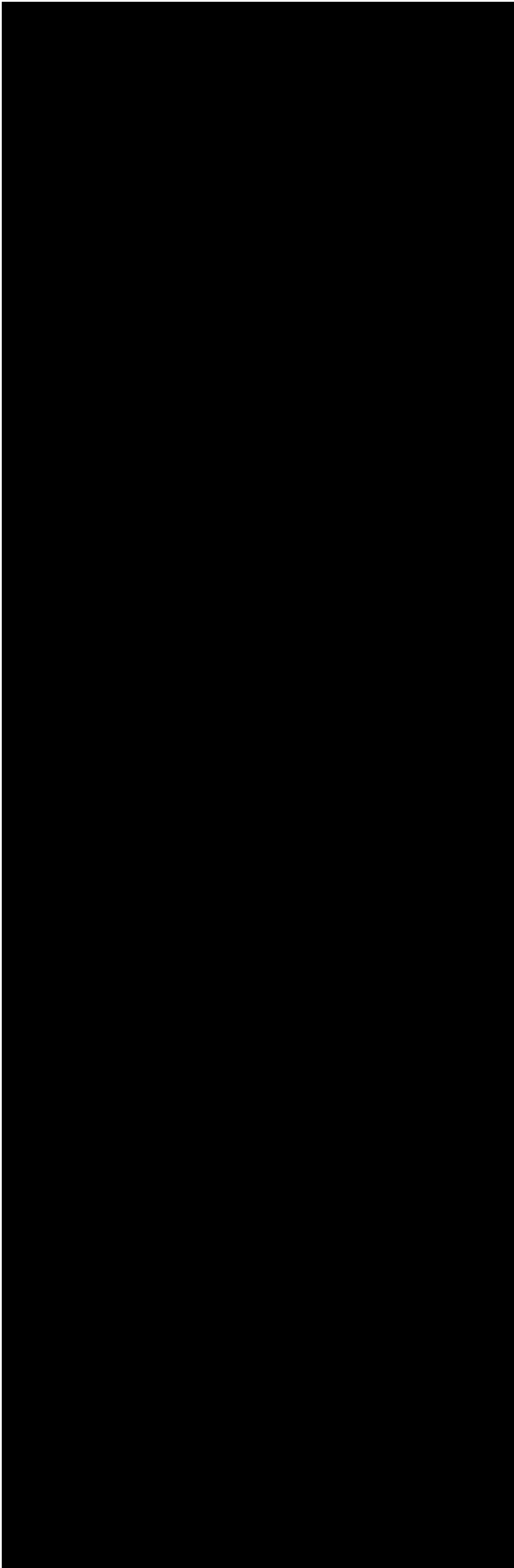


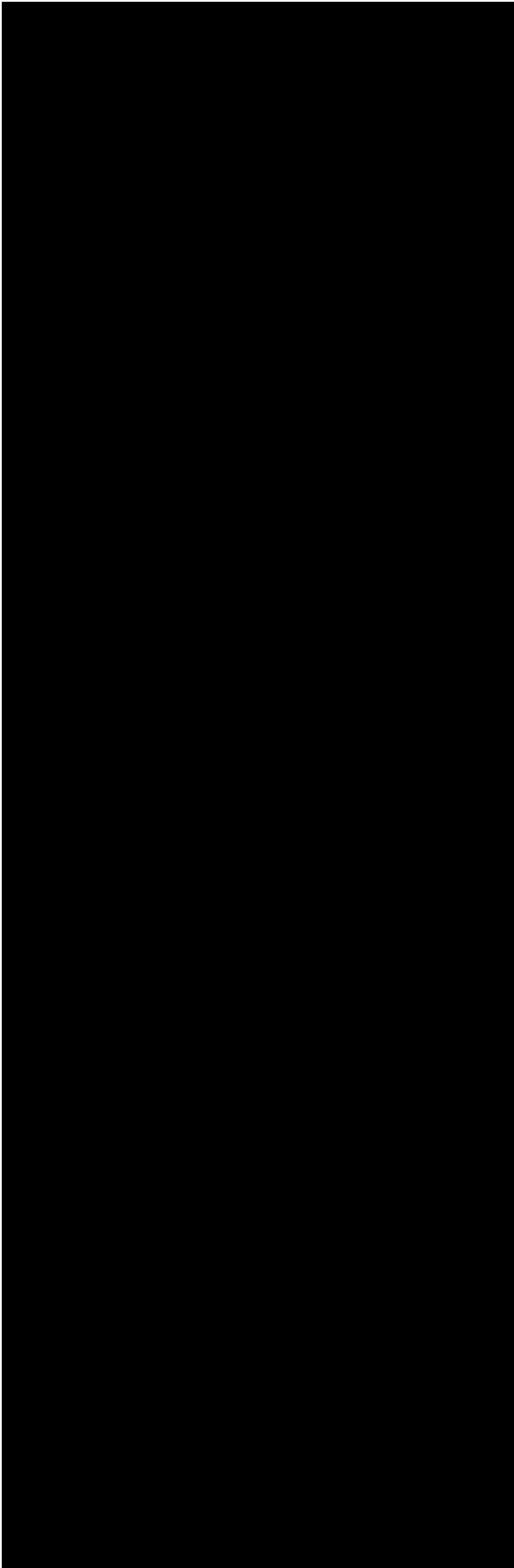


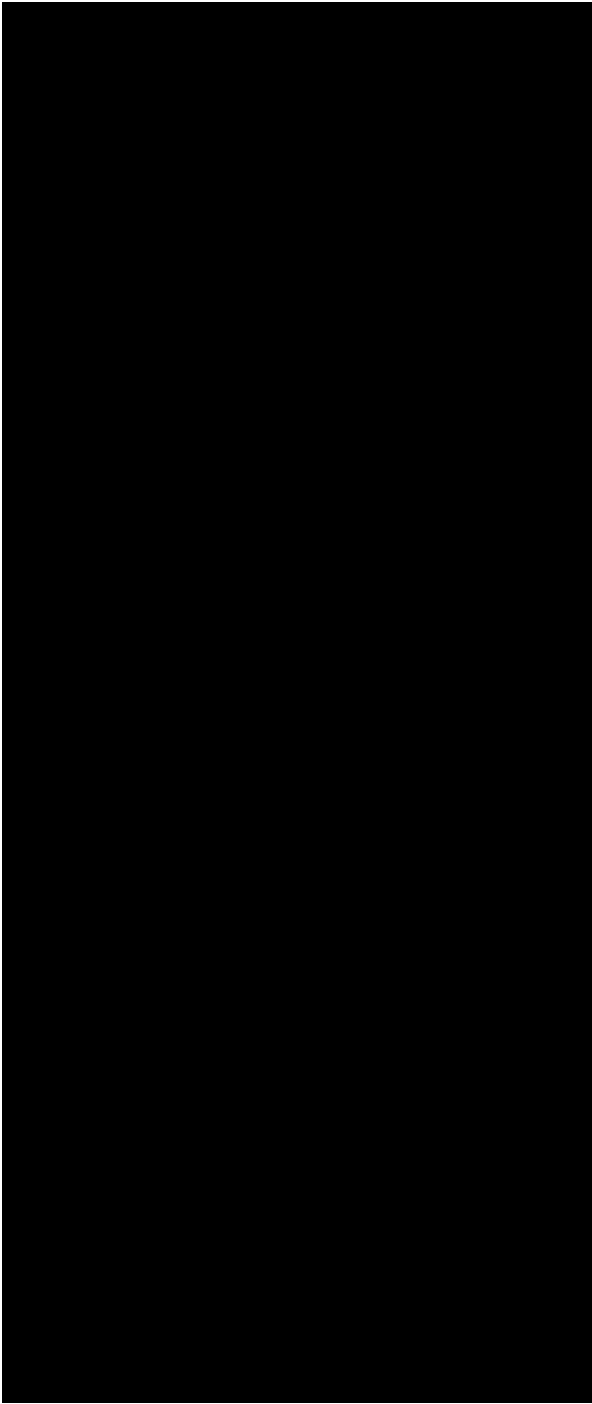


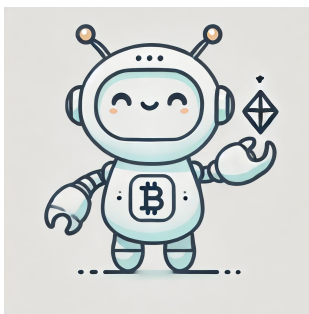












LSTMinator

Referência ao método de Machine Learning utilizado (LSTM) e ao Robô do filme Terminator

A Estratégia irá se basear no conceito de que, devido à alta volatilidade do mercado de Criptomoedas, modelos econometricos baseados em regressão são especialmente inefetivos para realizar previsões do valor esperado do retorno de certa moeda. Com isso, surge a necessidade de um modelo baseado em Machine Learning que consiga captar essa complexidade desse ativo. Nesse contexto, a arquitetura de Rede Neural: Long Short Term Memory se mostra potencialmente efetiva. Por fim, pretendendo usar como atributo de nosso modelo de aprendizado de máquina características não somente da moeda em questão, mas também das outras mais relevantes do mercado, visando capturar a informação de alta correlação do retorno entre esses ativos.

Trade

Criptomoedas

Criptos com volume de transação maior que 10^5

30

1 dia

Python

Modelo Econometrico baseado em Média Móvel Simples (SMA) será nosso BenchMark principal, mas também iremos comparar com o índice S&P500

