**Resumos sobre os artigos e possíveis trabalhos relacionados**

**Artigo 1**

Uma estratégia automatizada de investimento por meio de redes neurais artificiais e preditores econométricos **(estrategiaInvestimentoRedeNueralPreditor)**

**Algoritmos usados:**

Redes Neurais

SMA - Simple Moving Average

ARMA - Autoregressive Moving Average Model

ARIMA - Autoregressive Integrated Moving Average Model

GARCH - Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity

**Base de dados (Séries financeiras analisadas) usada:**

Companhia Energ´etica de Minas Gerais S.A. (CMIG4)

Embraer S.A. (EMBR3)

Itaú Unibanco Holding S.A. (ITUB4)

representando um índice foi utilizado o índice BOVESPA (BOVA11)

para um contrato futuro foi utilizada a commoditie de Boi Gordo (BGI$) negociada na Bolsa de Mercadorias & Futuros (BM&F) como derivativo

3 de janeiro de 2011 até 30 de dezembro de 2013

**Breve resumo**

a RNA com arquitetura Perceptron Múltiplas Camadas (PMC) + Preditores econométricos, foi estimado um conjunto de valores de preços de fechamento que serviu como entrada de um outra RNA PMC.

Foi comparado o desempenho da segunda RNA com os preditores econométricos, com a técnica buy and hold e com operações aleatórias.

linguagem de programação - R

plataforma para extração de dados - MetaTrader 5

Os resultados foram bons para os ativos do mercado de ações

Para o ativo de mercado futuro não foi bom, com lucros perto de zero

**Artigo 2**

Application of support vector machines in !nancial time series forecasting **(SVMinFinancialTimeSeriesStockIndexFuture)**

**Algoritmos usados:**

SVM com o estimador para problemas de regressão (basicamente a SVR)

**Base de dados (Séries financeiras analisadas) usada:**

5 contratos futuros da Chicago Mercantile**,** que é uma bolsa de mercadorias dos EUA, baseada em chicago

Standard&Poor 500 stock index futures (CME-SP)

United States 30-year government bond (CBOT-US)

United States 10-year government bond (CBOT-BO)

German 10-year government bond (EUREX-BUND)

Frenchgovernment stock index futures (MATIF-CAC40)

**Breve resumo**