

O Visitante
Visitante

Sazonalidade- varios sectores
« em: 2006-09-05 23:01:42 »

aqui fica

SECTOR INDEX SEASONALITY TABLE

Symbol	Sector Index		Months of Streak		Avg.% Return
			Start	End	
XNG	Natural Gas	(Bearish)	January	January	- 3.3
BKX	PHLX Banking		January	May	8.1
SOX	PHLX Semiconductor		January	January	8.2
UTY	PHLX Utility	(Bearish)	January	March	- 2.4
IIX	Internet	(Bearish)	February	February	- 5.3
XNG	Natural Gas		February	May	15.9
XAL	Airline		March	June	14.8
BTK	Biotechnology	(Bearish)	March	March	- 5.4
XOI	Oil		March	May	8.2
XBD	Securities Broker/Dealer		March	July	11.0
BTK	Biotechnology		April	June	7.5
IIX	Internet		April	June	6.9
SOX	PHLX Semiconductor		April	April	5.3
UTY	PHLX Utility		April	December	6.5
SOX	PHLX Semiconductor	(Bearish)	May	September	- 4.3
XNG	Natural Gas	(Bearish)	June	July	- 6.4
XAL	Airline	(Bearish)	July	September	-18.1
IIX	Internet	(Bearish)	July	August	- 5.1
RUT	Russell 2000	(Bearish)	July	October	- 4.1
BTK	Biotechnology		August	February	28.2
CYC	Morgan Stanley Cyclical	(Bearish)	August	September	- 5.3
XAU	PHLX Gold/Silver		August	September	6.1
DRG	Pharmaceutical		September	January	13.3
SOX	PHLX Semiconductor	(Bearish)	September	September	- 7.5
XAL	Airline		October	June	26.8
IIX	Internet		October	January	22.2
CMR	Morgan Stanley Consumer		October	May	13.5
CYC	Morgan Stanley Cyclical		October	April	13.7
MSH	Morgan/Stanley High-Tech		October	January	19.1
XTC	N. Amer Telecomm		October	January	14.3
NDX	Nasdaq 100		October	January	12.5
NDX	Nasdaq 100		October	June	18.4
COMP	Nasdaq Composite		October	January	11.0
COMP	Nasdaq Composite		October	June	15.1
BKX	PHLX Banking		October	May	14.0
XAU	PHLX Gold/Silver	(Bearish)	October	October	- 6.0
SOX	PHLX Semiconductor		October	April	29.3
XBD	Securities Broker/Dealer		October	January	18.2
PSE	Pacific SE High-Tech		November	January	12.9
RUT	Russell 2000		November	May	12.5
XOI	Oil		December	May	11.5
XAU	PHLX Gold/Silver		December	May	6.6

seasonality table.GIF (40.85 Kb, 720x689 - visto 319 vezes.)

Registado

Administrat
or



Mensagens
: 77750



« em: 2010-03-19 22:58:22 »

A análise abaixo permite a todos, simplesmente clickando nas diversas variáveis e períodos, estudar o que se passou em determinados anos, dias do mês, dias da semana e meses. Os valores apresentados são as rendibilidades médias diárias. Ou seja, sem qualquer selecção pode ver-se, com dados desde 1950, o que aconteceu num dado dia da semana, do mês, etc.

Mas também se pode seleccionar. Por exemplo, se seleccionarmos apenas 2010, os outros quadros passam a reflectir essa selecção, e torna-se óbvio que este ano o mercado tem subido intensamente nas segundas e terças feiras, e caído nas quintas e sextas (mas menos do que sobe).

Também é possível seleccionar múltiplos períodos (usar a tecla CTRL enquanto se clicka).

Powered by Tableau



<http://www.tableausoftware.com/public?ref=http://public.tableausoftware.com/views/SP500Sazonalidade/Dashboard1>
<http://www.tableausoftware.com/>

to sempre, poderão ser disponibilizados outros índices e outros tipos de análises, só têm que deixar as ou, eventualmente, os dados que as permitam realizar.

fim, quando descobrirem coisas curiosas, podem comentá-lo aqui.

« Última modificação: 2010-03-19 22:58:58 por Incognitus »

Registrado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein

Incognitus, www.thinkfn.com

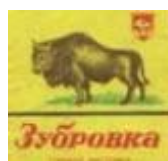
Tatankov
Ordem dos
Capitalistas
Selvagens

Mensagens:
8184



Re:Análise dinâmica – S&P500, Sazonalidade
« Responder #1 em: 2010-03-19 23:20:57 »

Curiosamente, 6^{af} é o dia mais forte de Março.
Claro, que os dados nao reflectem ainda o dia de hoje.



Registrado

Trading is like fish - just give me the middle of the trend, others can have the head and the tail



Incognitus

Administrator



Mensagens:
77750



Re:Análise dinâmica – S&P500, Sazonalidade

« **Responder #2 em:** 2010-03-19 23:26:20 »

No geral, não ... acabei de escolher somente Março (para todos os anos), e o que deu foi 3ª Feira como o dia mais forte (6ª é o 2º dia mais fraco mas positivo, segunda é o dia mais fraco).

Escolhendo Março desde 2005 a 2010, Sexta é de longe o dia mais fraco (-0.289% !!) segunda é o 2º dia mais fraco e mesmo assim só com -0.053%.

Registrado



"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein

Incognitus, www.thinkfn.com

Tatankov

Ordem dos
Capitalistas
Selvagens



Mensagens:
8184



Re:Análise dinâmica – S&P500, Sazonalidade

« **Responder #3 em:** 2010-03-19 23:59:50 »

Estava-me a referir apenas às 6ªs feiras mais recentes. Ou seja, seleccionando Março e o ano de 2010.

Registrado



Trading is like fish - just give me the middle of the trend, others can have the head and the tail

Incognitus

Administrator



Mensagens:
77750



Re:Análise dinâmica – S&P500, Sazonalidade

« **Responder #4 em:** 2010-03-20 00:03:34 »

Ah, isso já seria limitar demais, pois hoje era a terceira sexta-feira, só houve 2 mais... (e só essas estão a entrar na análise, diga-se).

Registrado



"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein

Incognitus, www.thinkfn.com



Incognitus

Administrator



Mensagens:
77750



Re:Análise dinâmica – S&P500, Sazonalidade

« Responder #5 em: 2010-03-22 11:42:50 »

Trago esta análise dinâmica para cima, porque quando a introduzi já era tarde na Sexta-Feira, e muitos podem não a ter visto antes de ter afundado para a segunda página.

 Registrado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein



Incognitus, www.thinkfn.com

Incognitus

Administrator



Mensagens:
77750



Re:Análise dinâmica – S&P500, Sazonalidade

« Responder #6 em: 2010-03-28 22:57:56 »

As selecções não se desmarcam a menos que cliques nas colunas de designação desse quadro em particular (é a forma de desmarcar).

Eu daqui para a frente faço este género de análises usando os quadros do género usado na análise dos Gaps do SPY, pois são mais intuitivos e fáceis de usar.

 Registrado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein



Incognitus, www.thinkfn.com

Incognitus
Administrator
★★★★★
Mensagens:
77750



Análise dinâmica – S&P500, Sazonalidade

« em: 2010-03-19 22:58:22 »

A análise abaixo permite a todos, simplesmente clicando nas diversas variáveis e períodos, estudar o que se passou em determinados anos, dias do mês, dias da semana e meses. Os valores apresentados são as rendibilidades médias diárias. Ou seja, sem qualquer selecção pode ver-se, com dados desde 1950, o que aconteceu num dado dia da semana, do mês, etc.

Mas também se pode seleccionar. Por exemplo, se seleccionarmos apenas 2010, os outros quadros passam a reflectir essa selecção, e torna-se óbvio que este ano o mercado tem subido intensamente nas segundas e terças feiras, e caído nas quintas e sextas (mas menos do que sobe).

Também é possível seleccionar múltiplos períodos (usar a tecla CTRL enquanto se clicka).

Powered by Tableau

Como sempre, poderão ser disponibilizados outros índices e outros tipos de análises, só têm que deixar ideias ou, eventualmente, os dados que as permitam realizar.

Por fim, quando descobrirem coisas curiosas, podem comentá-lo aqui.

« Última modificação: 2010-03-19 22:58:58 por Incognitus »

 Registrado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein

Incognitus, www.thinkfn.com

Tatankov
Ordem dos
Capitalistas
Selvagens
★★★★★
Mensagens:
8184



Re:Análise dinâmica – S&P500, Sazonalidade

« Responder #1 em: 2010-03-19 23:20:57 »

Curiosamente, 6ªf é o dia mais forte de Março.

Claro, que os dados nao reflectem ainda o dia de hoje.

 Registrado

Trading is like fish - just give me the middle of the trend, others can have the head and the tail



Incognitus

Administrator



Mensagens:
77750



Re:Análise dinâmica – S&P500, Sazonalidade

« Responder #2 em: 2010-03-19 23:26:20 »

No geral, não ... acabei de escolher somente Março (para todos os anos), e o que deu foi 3ª Feira como o dia mais forte (6ª é o 2º dia mais fraco mas positivo, segunda é o dia mais fraco).

Escolhendo Março desde 2005 a 2010, Sexta é de longe o dia mais fraco (-0.289% !!) segunda é o 2º dia mais fraco e mesmo assim só com -0.053%.

Registrado



"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein

Incognitus, www.thinkfn.com

Tatankov

Ordem dos
Capitalistas
Selvagens



Mensagens:
8184



Re:Análise dinâmica – S&P500, Sazonalidade

« Responder #3 em: 2010-03-19 23:59:50 »

Estava-me a referir apenas às 6ªs feiras mais recentes. Ou seja, seleccionando Março e o ano de 2010.

Registrado



Trading is like fish - just give me the middle of the trend, others can have the head and the tail

Incognitus

Administrator



Mensagens:
77750



Re:Análise dinâmica – S&P500, Sazonalidade

« Responder #4 em: 2010-03-20 00:03:34 »

Ah, isso já seria limitar demais, pois hoje era a terceira sexta-feira, só houve 2 mais... (e só essas estão a entrar na análise, diga-se).

Registrado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert



Einstein

Incognitus, www.thinkfn.com



Incognitus

Administrator



Mensagens:
77750



Re:Análise dinâmica – S&P500, Sazonalidade

« **Responder #5** em: 2010-03-22 11:42:50 »

Trago esta análise dinâmica para cima, porque quando a introduzi já era tarde na Sexta-Feira, e muitos podem não a ter visto antes de ter afundado para a segunda página.

 Registado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein



Incognitus, www.thinkfn.com

Incognitus

Administrator



Mensagens:
77750



Re:Análise dinâmica – S&P500, Sazonalidade

« **Responder #6** em: 2010-03-28 22:57:56 »

As selecções não se desmarcam a menos que cliques nas colunas de designação desse quadro em particular (é a forma de desmarcar).

Eu daqui para a frente faço este género de análises usando os quadros do género usado na análise dos Gaps do SPY, pois são mais intuitivos e fáceis de usar.

 Registado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein



Incognitus, www.thinkfn.com

Incognitus
Administrator
★★★★★
Mensagens:
77750



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« em: 2007-09-11 22:21:25 »

O dia de amanhã tem um pendor positivo. Vamos ver se acerta.

Registrado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein

Incognitus, www.thinkfn.com

bmwmb
Global
Moderator
★★★★★
Mensagens:
2318



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #1 em: 2007-09-13 01:00:19 »

1-0

Registrado

O Visitante
Visitante



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #2 em: 2007-09-13 01:22:16 »

vamos contar o resultado daqui a 250 dias (1 ano)

eu aposto num resultado proximo dos 125-125 fifty-fifty algo parecido a um stochastic , a nao ser que os mercados tenham mudado muito eheh

Registrado

Incognitus
Administrator
★★★★★



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #3 em: 2007-09-13 08:57:14 »

Mensagens:
77750



 Registrado

Pode ser, mas a ideia seria só seguir sinais fortes. Por exemplo hoje embora exista um pendor muito ligeiramente negativo, é demasiado próximo do zero para dizer algo.

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein



Incognitus, www.thinkfn.com

Incognitus
Administrator
★★★★★
Mensagens:
77750



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #4 em: 2007-09-14 21:22:51 »

O dia 17 de Setembro tem uma forte preponderância de dias maus:

17 de Setembro 23.08% -0.39% 13

Vamos ver se acerta.

 Registrado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein



Incognitus, www.thinkfn.com

nikopol
Think Finance
★★★★★
Mensagens: 179



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #5 em: 2007-09-14 21:54:23 »

Fico surpreendido por não deixar de ficar surpreendido, quando nos dias que correm, vejo adultos a desperdiçarem tempo e inteligência com estas coisas...

LOL!

 Registrado

Incognitus
Administrator
★★★★★
Mensagens:



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #6 em: 2007-09-15 10:05:41 »

heheh, nikopol, a ideia vai ser juntar um número elevado de variáveis, e só lhes dar atenção quando parecem afastar-se do random (e não dar na maior parte do tempo).

77750



Alguns dias por ano possuem bons motivos para que os seus movimentos não sejam random.

 Registrado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein



Incognitus, www.thinkfn.com

Guloso

Task Force
Formula
Research



Mensagens:
1252



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #7 em: 2007-09-15 13:20:33 »

Citar

O dia 17 de Setembro tem uma forte preponderância de dias maus:



Há uma explicação para isto:

17 de Setembro de 2001. Dia em que os mercados reabriram depois do 11 de Setembro, com acentuadas quedas. (nota que sem este dia a média continuava a ser negativa)

Este é o problemas das médias, com poucas observações (13). A existência de valore(s) extremo(s) distorcem a média.



Porque é que não calculas a mediana?

 Registrado

Incognitus

Administrator



Mensagens:
77750



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #8 em: 2007-09-15 14:10:35 »

Bem, não é apenas um problema da média, eu neste caso daria mais importância a quase 80% dos dias 17 de Setembro serem negativos. Claro que pode ser coincidência dado o número baixo de observações, mas em princípio SE existir algum valor, será na taxa de quedas/subidas que ele se tornará mais evidente.

 Registrado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein





Incognitus, www.thinkfn.com

Incognitus

Administrator



Mensagens:
77750



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« **Responder #9** em: 2007-09-17 20:57:29 »

Acertou ... eheh.

Já o dia de amanhã não difere suficientemente de random e ainda tem a lotaria do FED.

Registrado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein



Incognitus, www.thinkfn.com

Mystery

long vega short
feta

Think Finance



Mensagens:
1758



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« **Responder #10** em: 2007-09-17 22:50:52 »

A sazonalidade desde a ultima 6a feira até ao fim do mês de Setembro costuma ser bastante desfavoravel...

Registrado

Doubt is not a pleasant condition, but certainty is absurd.



Incognitus

Administrator



Mensagens:
77750



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« **Responder #11** em: 2007-09-17 22:53:09 »

Sim, eu para já tb tenho a capacidade de verificar períodos diferentes de 1 dia, mas como o report é pré-calculado torna-se pouco prático colocar tudo (prazos diferentes, indices diferentes, etc).

O ideal seria distribuir o programa já que ele se consegue auto-actualizar. Mas aí o problema é



que ele se baseia numa BD em SQL Server, e isso não é tão fácil de as pessoas possuírem, só se eu incluísse uma instância do SQL Server Express.

 Registrado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein



Incognitus, www.thinkfn.com

Mystery

long vega short
feta

Think Finance



Mensagens:
1758



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #12 em: 2007-09-17 23:10:51 »

desliga o complicómetro...

eu calculo tudo uma vez por ano, exporto para excel e construo uma folha que "soma" em cada dia as tendências sazonais/cíclicas predominantes.

Assim fico com uma estimativa para cada dia da semana logo no inicio do ano...

(Já posteí o modelo anteriormente aqui no forum)

 Registrado



Doubt is not a pleasant condition, but certainty is absurd.

Pollito

Think Finance



Mensagens: 507



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #13 em: 2007-09-18 17:42:21 »

Citação de: "Mystery"

(Já posteí o modelo anteriormente aqui no forum)

Procurei mas não encontrei. Seria muita maçada indicar ou postar outra vez?

 Registrado



Mystery

long vega short



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #14 em: 2007-09-18 22:33:05 »

feta
Think Finance
★★★★★
Mensagens:
1758



<http://www.thinkfn.com/forum/viewtopic.php?t=9826>

 Registrado



Doubt is not a pleasant condition, but certainty is absurd.

bmwmb
Global
Moderator
★★★★★
Mensagens:
2318



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #15 em: 2007-09-18 23:41:55 »

Mistery, o que são "if best six months" e "if favorable four year cycle"?

 Registrado

Incognitus
Administrator
★★★★★
Mensagens:
77750



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #16 em: 2007-09-19 09:16:04 »

Se estiver nos melhores seis meses (Novembro, Dezembro, Janeiro, Fevereiro, Março, Abril)?

Se estiver no ponto do ciclo de quatro anos favorável (será o ciclo presidencial? O ano anterior às eleições é favorável – já agora estamos num).

 Registrado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein



Incognitus, www.thinkfn.com

Mystery
long vega short
feta
Think Finance
★★★★★
Mensagens:
1758



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #17 em: 2007-09-19 12:02:13 »

Citação de: "Incognitus"

Se estiver nos melhores seis meses (Novembro, Dezembro, Janeiro, Fevereiro, Março, Abril)?

Se estiver no ponto do ciclo de quatro anos favorável (será o ciclo presidencial? O ano anterior às eleições é favorável – já agora estamos num).

exactamente!

 Registrado



Doubt is not a pleasant condition, but certainty is absurd.

Incognitus
Administrator
★★★★★
Mensagens:
77750



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #18 em: 2007-09-20 21:36:11 »

O dia de amanhã volta a ter uma grande preponderância de dias negativos:

21 de Setembro 13.33% -0.57% 15

 Registrado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein



Incognitus, www.thinkfn.com

Incognitus
Administrator
★★★★★
Mensagens:
77750



Segundo a ferramenta da Sazonalidade ...

« Responder #19 em: 2007-09-21 20:04:20 »

ppfft .. apesar de um forcing final, falhou miseravelmente.

 Registrado

"Nem tudo o que pode ser contado conta, e nem tudo o que conta pode ser contado.", Albert Einstein

Incognitus, www.thinkfn.com

