



Projeto de Formatura – 2023 – Press Release

PCS - Departamento de Engenharia de Computação e Sistemas Digitais

Engenharia de Computação

Tema:

Estratégias de Investimento com Base na Previsão da Direção de Mercado

Estudantes da USP desenvolvem estratégias de investimento baseadas na previsão da direção do mercado financeiro

Nos dias 19 e 20 de dezembro, os alunos Gabriel de Souza Oliva e Vinicius Akira Imaizumi apresentarão o trabalho orientado pelo professor Dr. Luiz Pizzigatti Corrêa, desenvolvido na Escola Politécnica da Universidade de São Paulo (USP), onde será exposto na feira de projetos de formatura do departamento de engenharia da computação.

O objetivo do projeto é fornecer uma estratégia de investimento baseada na previsão da volatilidade e direção da mudança do mercado. A performance dessa estratégia é comparada com o índice Ibovespa, utilizado como benchmark. A implementação ocorre a partir de um modelo conhecido como *polymodels*, composto por um conjunto de modelos univariados, todos eles compartilhando o mesmo alvo. Essa é uma aplicação inédita deste modelo que apresenta diversas vantagens.

Foram utilizados 60 atributos como indicadores financeiros relacionados a surpresas e incertezas do mercado, spreads de crédito e sinais de volatilidade, obtidos principalmente da plataforma de dados Refinitiv, durante o período de 2004 a 2023. A partir dos dados desse período, foram realizados alguns testes com o índice Ibovespa e também o S&P 500, com horizontes de previsão de 5, 10, 22 e 66 dias.

Com esse trabalho, os alunos esperam contribuir de forma positiva para a gestão de investimentos, de modo que, ao conhecer a provável direção do mercado, os investidores poderão alocar recursos de forma eficaz, maximizando os lucros e minimizando os riscos. Dessa forma, ele orientará a tomada de decisões nas áreas de finanças, negócios e política econômica.

Integrantes: Gabriel de Souza Oliva
Vinicius Akira Imaizumi

Professor(a) Orientador(a): Prof. Dr. Pedro Luiz Pizzigatti Corrêa
