

Estudo de Caso 02: Avaliação e comparação do retorno médio de ações

Diego Pontes, Elias Vieira, Matheus Bitarães

Fevereiro, 2021

Descrição do problema

Introdução

Design do Experimento

Análise Estatística

Importação dos dados

Os dados das ações foram importados do arquivo *DadosAcoesGrupoC.csv*.

```
# importação dos dados
data <- read.csv(file = 'DadosAcoesGrupoC.csv', header = FALSE)
colnames(data) <- c("A1", "A2", "A3", "A4", "A5") # Adicionando nomes às colunas

# plot dos primeiros 6 dados da tabela
head(data)
```

```
##      A1      A2      A3      A4      A5
## 1 26.649 12.302 21.006 18.553 33.937
## 2 26.057 12.250 21.032 18.385 33.443
## 3 25.545 12.541 20.816 18.555 33.018
## 4 25.143 12.649 20.790 18.513 33.050
## 5 25.124 12.531 20.553 18.376 32.758
## 6 24.451 12.511 20.520 18.490 32.094
```

Cada coluna representa uma ação e cada linha representa o preço de fechamento das ações no mes anterior. Portanto, a linha 1 indica o preço de fechamento do mes atual - 1, a linha 2 representa o mes atual - 2, e assim sucessivamente.

[matheus] como compararemos as ações? Acho que uma forma pode ser armazenarmos os deltas entre meses e utilizarmos isso para compararmos (tipo, se os preços de fechamento forem 40, 35, 40, 50, 60 a gente teria um array de deltas assim: -5 5 10 10. Aí estimariamos o potencial do próximo mes assim. Mas não sei se é a melhor maneira... acho que no mercado financeiro o pessoal tenta estimar as series temporais, fazendo altas modelagens e tals. Mas acho que esse nao é o proposito desse trabalho...

Tratamento dos dados

Dados estatísticos

Discussão e Conclusão

Atividades dos membros

Diego

Elias

Matheus

Todos

Elaboração das hipóteses e definição das premissas.