



Apresentação Institucional FEA.dev

História e Showcase







FEA.dev

O que fazemos hoje

Principais atividades

Quantamental 2024

Emovere









Como surgiu e o que já alcançamos

FEA.dev

Nossos Fundadores





Economia – FEA-USP Fundador da Palver Colunista Folha de São Paulo



Economia – FEA-USP Itaú, Senior Data Engineer

Didática



Trabalhamos Disseminando Conhecimento em Python





Challenges



Participamos de Challenges de Data Science e Finanças Quantitativas

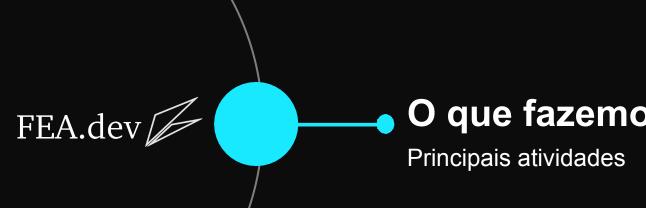
- 4º lugar Quantamental 2024
- Campeões Quantamental 2023
- Finalistas Quantamental 2022
- Finalistas FGV Datathon 2024
- Campeões FGV Datathon 2023
- Campeões FGV Datathon 2022











O que fazemos hoje

Core em Projetos



Fazemos Diversos Projetos Ligados a Programação

Neste ano:

- Análise sobre noticías do "Liberation Day"
- Análise preditiva do mercado financeiro com IA
- Parceria com o CAVC com processo de apadrinhamento
- Conversa com a Kinea Investimentos
- Parceria com a Palver
- Carteira MSGARCH Deep Markovian Trader









Quantamental 202

Emovere



Estratégia

Qual o melhor momento para reotimizar uma carteira de investimentos em ações?

• Momentos com alteração da dinâmica do sentimento □ Otimização do portfólio

Momentos com alteração da dinâmica do sentimento de mercado

Otimização do portfólio

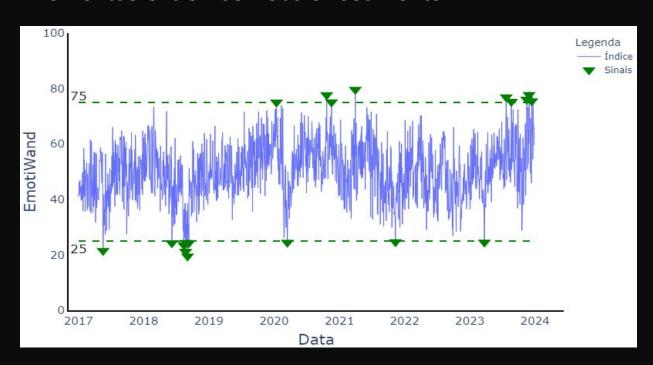




Emotiwand

Criação de um índice Fear and Greed autoral para o mercado brasileiro

Momentos extremos: rebalanceamento



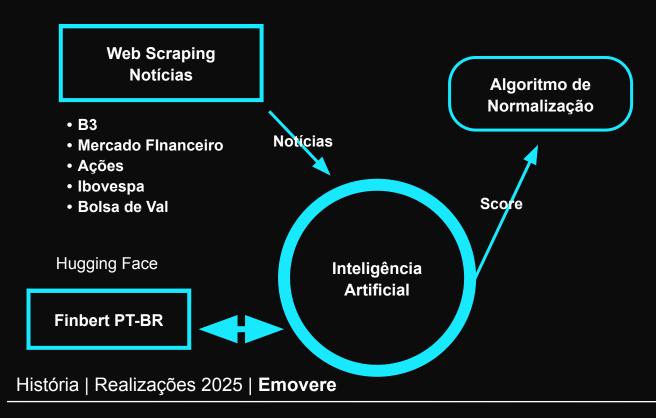
Com o sinal, temos momentos com alteração da dinâmica do sentimento do mercado

Ativado o sinal, são alocados novos pesos para os ativos



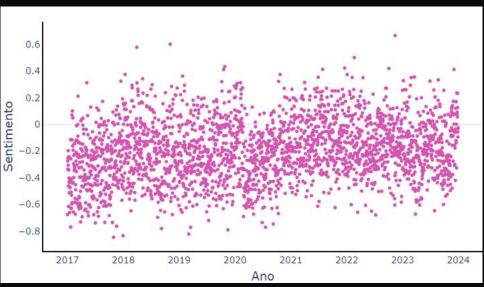
Estratégia - Reotimização

Modelagem – Análise de Sentimentos dos Jornais



40% Sentimento de Notícias







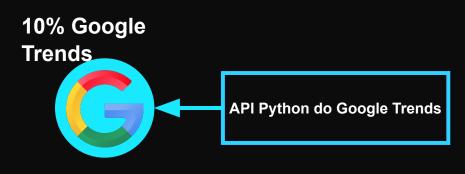
Estratégia - Reotimização

Modelagem – Criação do Índice Fear & Greed

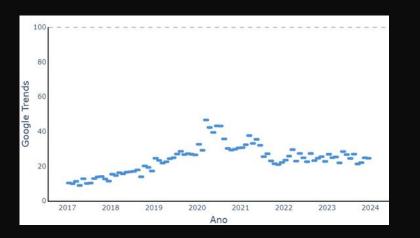
25% VIX

NEFIN

S&P/B3



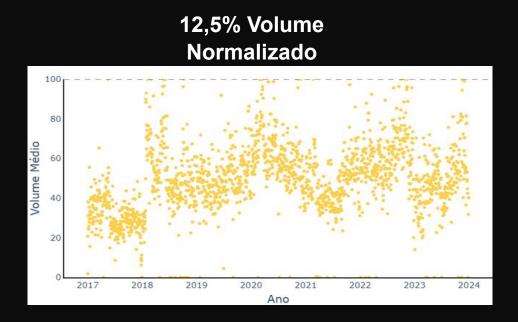
35
30
25
20
15
Jan 2022
Jul 2022
Jan 2023
Jul 2023
Jan 2024
Jul 2024
Data

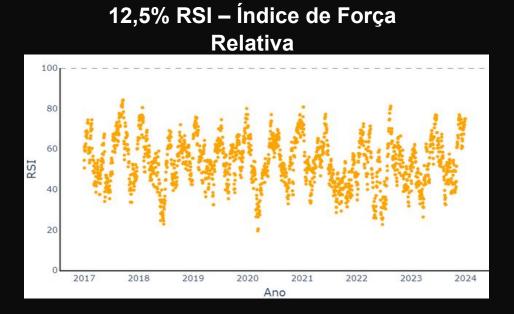




Estratégia - Reotimização

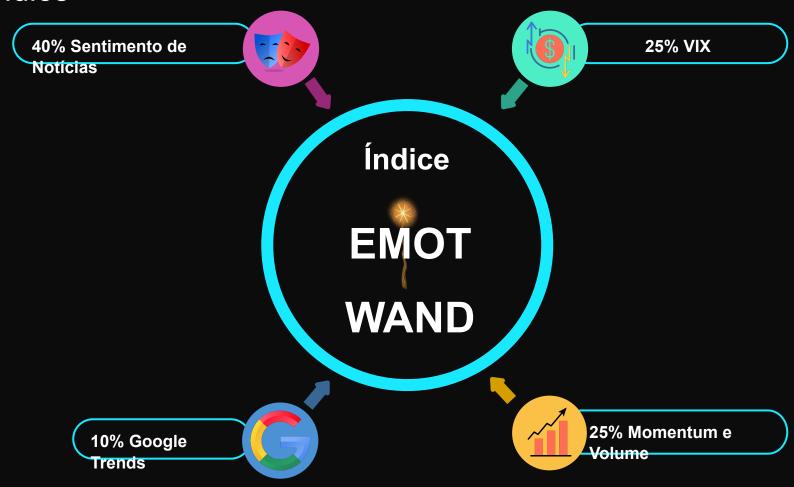
Modelagem – Criação do Índice Fear & Greed





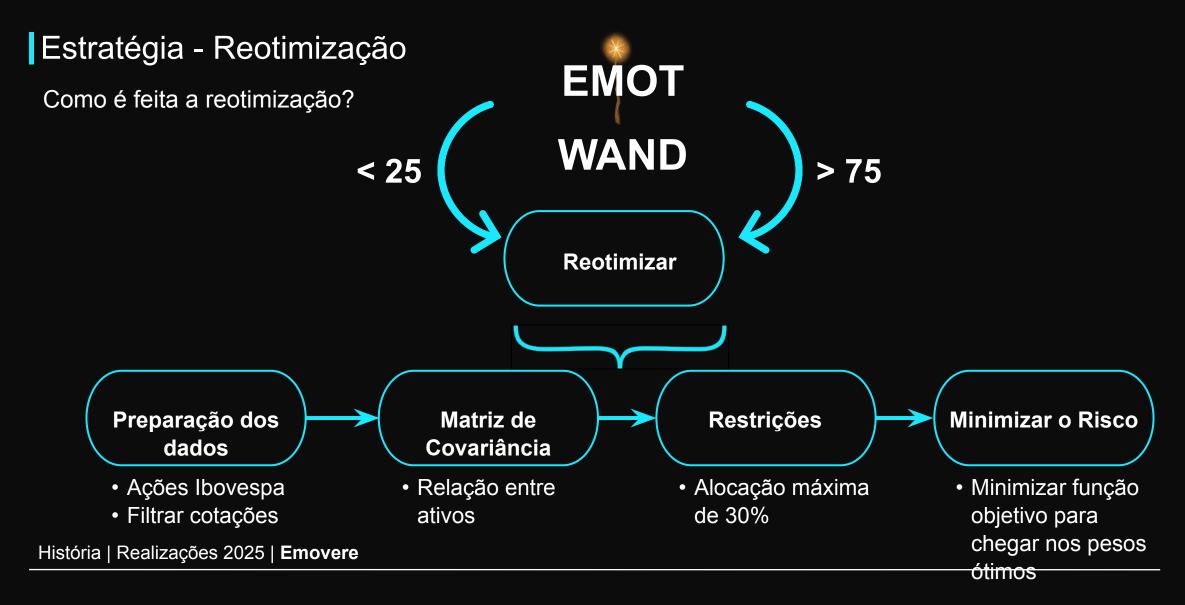


Resumo do Índice



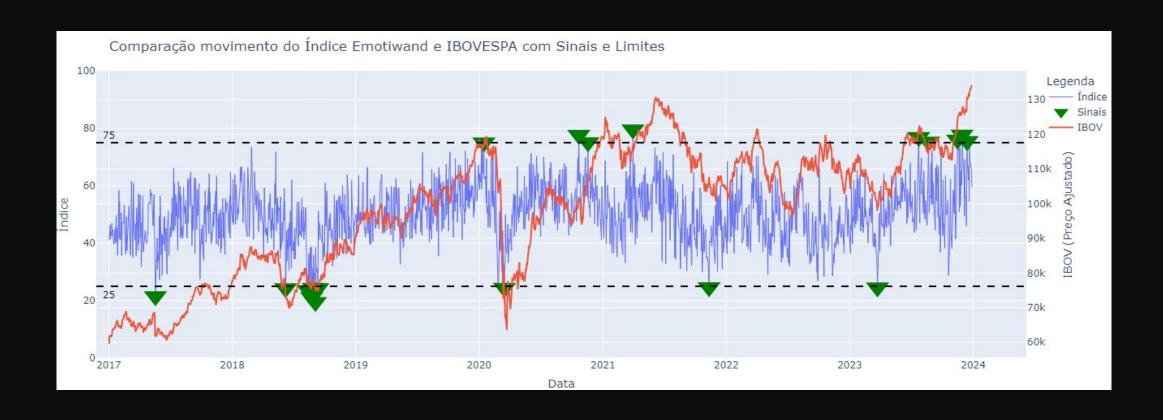
História | Realizações 2025 | **Emovere**



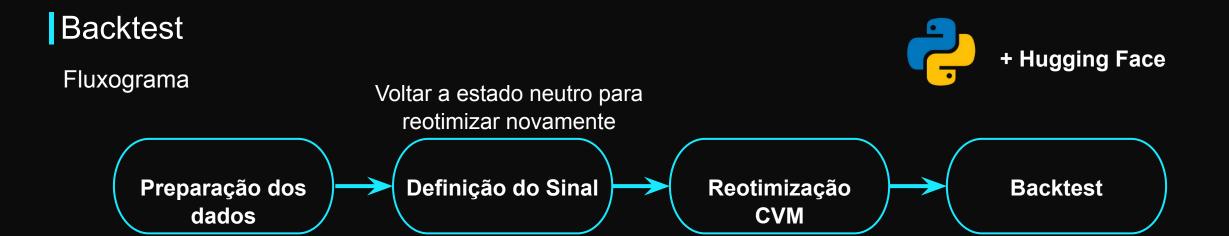




Índice Fear & Greed







Carteiras:

- Ibovespa
- CVM reotimizada quinzenalmente
- CVM reotimizada dinamicamente pelo EmotiWand



Backtest

Controlando Vieses



Look-Ahead Bias

 Normalização apenas com dados do passado



Time Period Bias

• Testes com 7 anos de dados



Parâmetros de controle

• Sem ajuste fino para evitar overfitting



Survivorship Bias

 Todos os ativos do Ibovespa no período



Resultados



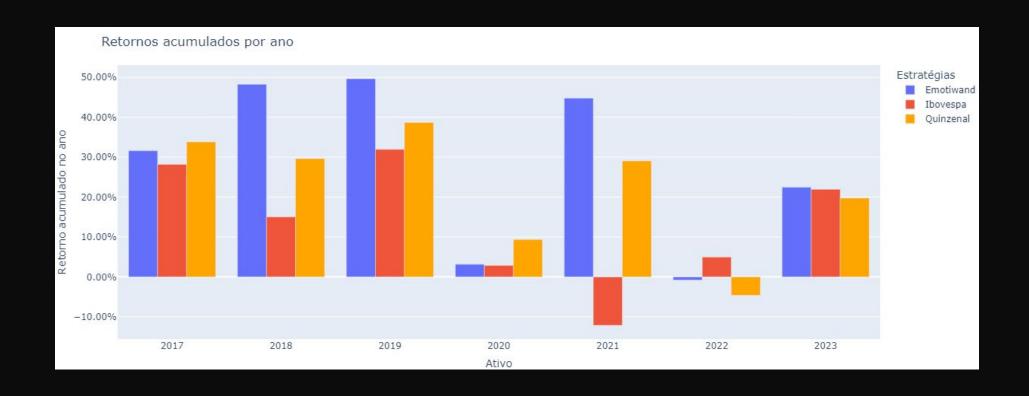


Resultados

Índice/Estratégia	Emotiwand	CVM Quinzenal	Ibovespa
Retorno Total	429,87%	287,98%	125,19%
CAGR	26,97%	21,42%	12,33%
Volatilidade	22,97%	15,76%	15,57%
Sharpe	1,22	1,29	0,69
CVaR	-2.51 %	-2.30 %	-3.56 %
Max Drawdown	-31,99%	-30,76%	-46,81%
Melhor Ano	49,65%	28,68%	31,95%
Pior Ano	-0,79%	-4,62%	-12,14%
Sortino Ratio	86,72	10,77	2,17



Resultados





FEA.dev

QSA