**Case Mercado Financeiro (Ações / Ibovespa)**

Reprograma

On34

Componentes: Márcia Reginato, Pricila Magalhães

**Contexto:**

Sua empresa foi contratada por uma empresa de investimentos que deseja melhorar suas estratégias de análise de ações no mercado financeiro brasileiro. Seu foco será o Ibovespa, com ações mais negociadas no último ano no principal índice de ações da Bolsa de Valores do Brasil (B3).

**Sobre a Bolsa de Valores:**

É o principal índice da Bolsa de Valores do Brasil (B3) e mede o desempenho das ações mais negociadas e representativas do mercado brasileiro. Serve como um termômetro do mercado de ações brasileiro, refletindo a performance das principais empresas listadas na B3.

Atualmente, 68 empresas fazem parte do Ibovespa, índice que reúne as companhias com ações mais negociadas na B3, dentre elas, 42 estão dentro do segmento do Novo Mercado. Sete dessas empresas, são consideradas como destaque: Vale (VALE3); Cielo (CIEL3); CVC (CVCB3); Raia Drogasil (RADL3); Magazine Luiza (MGLU3); Banco do Brasil (BBAS3) e Fleury (FLRY3).

**Sobre termos importante do banco:**

**1. Adj Close (Adjusted Close):**

- O que é: É o preço de fechamento ajustado de uma ação.

- Por que é importante: esse valor ajusta o preço de fechamento para eventos como dividendos, desdobramentos (splits) e emissões de novas ações, proporcionando uma visão mais precisa do valor real da ação ao longo do tempo.

**2. High:**

- O que é: É o preço mais alto que uma ação atingiu durante o dia de negociação.

- Por que é importante: Indica o ponto máximo de valorização da ação em um determinado dia, ajudando a entender a volatilidade e o comportamento do mercado.

**3. Open:**

- O que é: É o preço de abertura de uma ação no início do dia de negociação.

- Por que é importante: Representa o preço inicial pelo qual a ação foi negociada quando o mercado abriu, servindo como referência para o desempenho ao longo do dia.

**4. Low:**

- O que é: É o preço mais baixo que uma ação atingiu durante o dia de negociação.

- Por que é importante: Indica o ponto mínimo de desvalorização da ação em um determinado dia, ajudando a avaliar os riscos e a volatilidade.

**5. Volume:**

- O que é: É o número total de ações negociadas durante o dia.

- Por que é importante: O volume mostra a liquidez da ação e pode indicar o nível de interesse dos investidores. Um volume alto geralmente significa que há muita atividade de compra e venda.

Esses termos são fundamentais para analisar o desempenho das ações e tomar decisões informadas no mercado de valores.

**Sobre a Teoria Dow:**

A Teoria de Dow, desenvolvida por Charles Dow, é uma das mais antigas e influentes teorias sobre o comportamento dos mercados financeiros. Seus princípios básicos incluem:

Os Mercados Descontam Tudo: Todos os fatores que influenciam o preço das ações já estão refletidos nos preços de mercado.

O Mercado Tem Três Movimentos: Tendências primárias (longo prazo), secundárias (médio prazo) e menores (curto prazo).

As Tendências Primárias Têm Três Fases: Acumulação, participação pública e excesso/distribuição.

Os Índices Devem Confirmar-se Mutuamente: Para validar uma tendência, os principais índices de mercado devem se mover na mesma direção.

O Volume Deve Confirmar a Tendência: O volume de negociações deve aumentar na direção da tendência principal.

Uma Tendência Continua Até Que Uma Reversão Clara Ocorra: As tendências continuam até que haja sinais claros de mudança.

Esses princípios ajudam os investidores a analisar e prever os movimentos do mercado, tornando a Teoria de Dow uma ferramenta valiosa para a análise técnica.

**Recomendação de sites para estudos:**

**Objetivo:**

Realizar uma análise técnica dos dados do Ibovespa com base na teoria de Dow, para responder às três perguntas estratégicas abaixo, utilizando um dataset de ações do Ibovespa do último ano.

**Perguntas:**

1. **Quais são as principais tendências do Ibovespa ao longo do último ano?**

**-**Justificativa: Segundo a teoria de Dow, o mercado apresenta tendências primárias, secundárias e terciárias. Identificar essas tendências é essencial para entender a direção geral do mercado e tomar decisões de investimento.

1. **Há evidências de reversões de tendência nos últimos meses?**

-Justificativa: A teoria de Dow enfatiza a importância de identificar reversões, pois elas podem representar pontos críticos para decisões de compra e venda. Reconhecer padrões de reversão é fundamental para os investidores.

1. **Qual é a relação entre o volume de negociação e os movimentos de preços no Ibovespa?**

-Justificativa: O volume é um indicador importante na teoria de Dow. Um aumento no volume pode confirmar a força de uma tendência, enquanto uma diminuição pode sugerir fraqueza. Compreender essa relação é crucial para uma análise mais robusta.

**Bancos utilizados e metodologia:**

- Extração:

- Importação da biblioteca do “yfinances” e “emplfinance”, atualizados até o dia 01 de outubro de 2024.

- Importação das bibliotecas Pandas, Matplotlib, Seaborn.

- Criação de csv com a atualização diária da carteira de ações da IBOVESPA das empresas pesquisadas.

- Tratamento:

- Conhecer o banco.

- Filtragem, adição e exclusão de colunas.

- Visualização através de gráficos sobre o comportamento dos dados.

- Loading:

- Salvar arquivo csv.

- Compartilhamento com a equipe e a orientadora.

**Entregáveis Esperados:**

- Um relatório contendo insights e visualizações que ajudem a responder às perguntas acima.

- Gráficos de tendências de crescimento, volatilidade e volume de negociação.

- Conclusões baseadas nas análises, incluindo sugestões de possíveis ações para o time de investimentos.

**Ferramentas a serem utilizadas:**

- Python (Pandas, Matplotlib, Seaborn)

- Excel/Google Sheets

- Tableau

**Duração estimada:**

2 semanas.

**Links acompanhamento de trabalho:**

[Escopo Projeto Reprograma - Planilhas Google](https://docs.google.com/spreadsheets/d/1csXukW47EBUQspl6dC_9hv35271QGrloOUK4zfKrPGg/edit?gid=1264261886#gid=1264261886)