

Bootcamp: Cientista de Renda Fixa

Desafio Prático

Módulo 3: Métodos e estratégias quantitativas para a Renda Fixa

Objetivos de Ensino

Exercitar os seguintes conceitos trabalhados no Módulo:

1. Entendimento do processo de aquisição de dados.
2. Entendimento da sintaxe em Python para programar uma rede neural.
3. Entendimento do processo de modelagem matemática.
4. Entendimento do porquê modelos podem performar de modo inapropriado.

Enunciado

1. Reproduza o código da aula de redes neurais artificiais para prever o spread do título público Tesouro IPCA com vencimento em 2035;
2. Reproduza o mesmo código acima, mas alterando o alvo para:
`ipca_limpo["Alvo"] = ipca_limpo["Retornos"].rolling(20).std().shift(-1)`

Atividades

Os alunos deverão desempenhar as seguintes atividades:

1. Execute os dois códigos, conforme instrução acima, em 2 arquivos diferentes;
2. De modo lógico, compare os resultados em termos de performance do modelo.