

Breve análise de índices financeiros mundiais em Setembro de 2025

Arthur Vasconcelos

25 de Setembro de 2025

1 Introdução

Os índices financeiros são indicadores amplamente utilizados para sintetizar o desempenho de diferentes mercados de capitais ao redor do mundo. Sua análise fornece uma visão agregada sobre tendências de valorização, volatilidade e liquidez, sendo, portanto, ferramenta central tanto para pesquisadores quanto para investidores. Em particular, acompanhar oscilações de curto prazo e a posição relativa dos índices em relação a seus extremos históricos pode revelar sinais sobre o momento dos mercados e sobre a percepção de risco e oportunidade.

Com o avanço das ferramentas de coleta e tratamento de dados, torna-se cada vez mais acessível realizar análises exploratórias a partir de informações disponibilizadas em tempo real em plataformas financeiras. Nesse contexto, técnicas de *web scraping* possibilitam a extração automática de dados atualizados para posterior investigação estatística.

2 Objetivo

O objetivo deste trabalho é realizar uma análise exploratória de índices financeiros mundiais, buscando identificar padrões recentes de variação e posicionamento no contexto do mês de setembro de 2025. A proposta é oferecer uma visão sintética do comportamento dos principais mercados a partir de medidas descritivas simples e representações gráficas.

3 Metodologia e dados

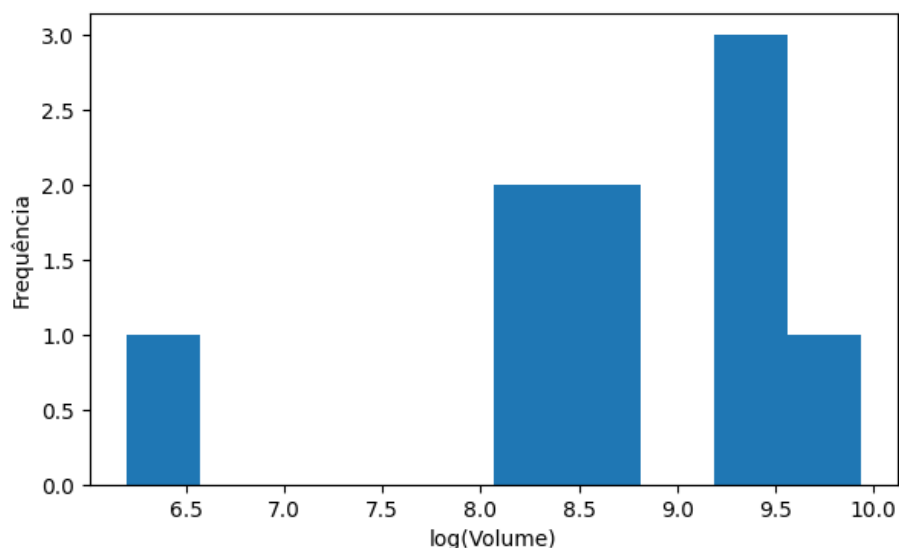
Os dados foram coletados por meio de *web scraping* na plataforma Yahoo Finance [1] por meio da biblioteca `rvest`, especificamente na seção dedicada a índices globais, às 17:00 do dia 25/09/2025. Após a coleta, as informações foram tratadas e organizadas com o auxílio das bibliotecas `pandas` e `numpy`, no ambiente Python. A etapa de análise exploratória incluiu o uso de gráficos elaborados com o `matplotlib`, além do cálculo de medidas estatísticas básicas que permitem resumir tendências e oscilações observadas nos diferentes índices.

As variáveis utilizadas no estudo incluem o valor atual do índice, a variação absoluta e percentual em relação ao fechamento anterior e o volume diário negociado, além das faixas mínima e máxima observadas tanto no dia corrente quanto nos últimos doze meses.

4 Resultados

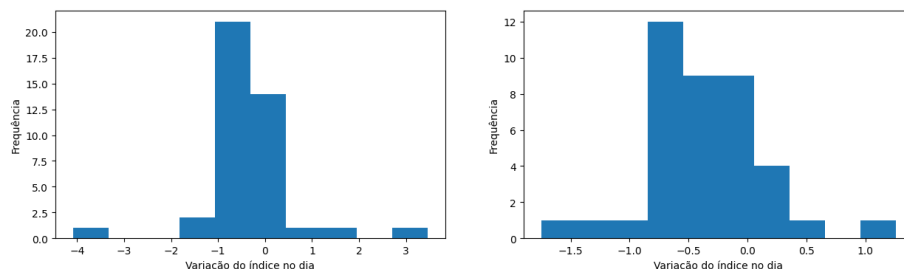
Entre os 41 índices avaliados, apenas 9 têm seu volume de negociação diária exposto, e é perceptível que têm magnitudes diferentes, conforme a Figura 1. Enquanto a maioria está concentrado nas centenas de milhões ou unidades de bilhões, o NASDAQ, dos EUA, se apresenta como o índice com maior volume, enquanto a bolsa de valores de Moscou tem o menor, na casa dos milhões.

Figura 1: Distribuição do logaritmo do volume diário negociado (em dólares) dos índices, às 17 horas do dia 25 de Setembro de 2025.



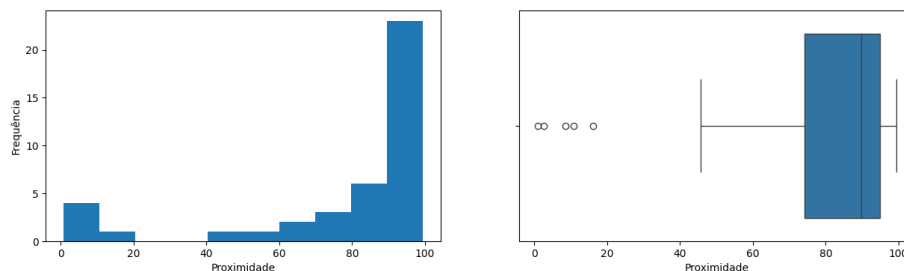
Verificamos, através da Figura 2, que há dois destaques nesse dia: o CBOE VIX apresentou alta de 3.46% com relação ao dia anterior, enquanto a bolsa de Buenos Aires teve queda de 4.09%. Além desses valores, observa-se que poucos índices se valorizaram com relação ao dia anterior, sendo que a maioria ficou na faixa de desvalorização de -1% a 0 .

Figura 2: Distribuição da variação do preço dos índices (em %) com relação ao dia anterior, às 17 horas do dia 25 de Setembro de 2025.



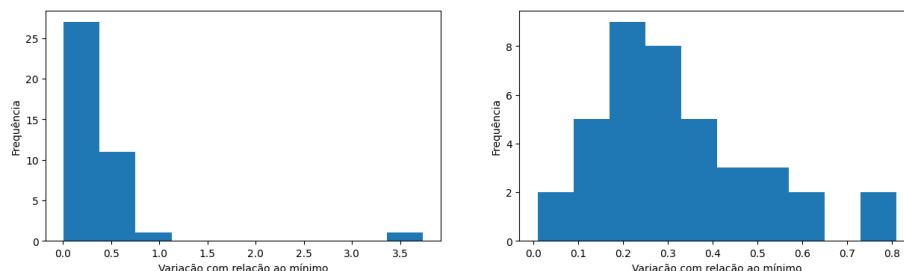
Também é possível avaliar que a maioria dos índices está com o valor atual mais próximo da máxima do que da mínima (contando as últimas 52 semanas), com metade beirando a máxima. A Figura 3, que ilustra essa situação, é construída de modo que 0 representa o preço atual ser igual ao valor mínimo, enquanto 100, ser igual ao valor máximo. As bolsas de Tóquio, Seul e Jacarta apresentam esse valor superior a 99, enquanto os cinco outliers observados são, do menor para o maior valor: bolsa do Cairo, bolsa de Moscou, CBOE VIX, bolsa de Buenos Aires e DX-Y.NYB; estes estão mais perto do valor mínimo.

Figura 3: Distribuição da proximidade do preço atual dos índices com relação à máxima das últimas 52 semanas, às 17 horas do dia 25 de Setembro de 2025.



Ao compararmos a mínima e a máxima das últimas 52 semanas de cada índice, podemos verificar quais apresentaram maior amplitude de diferença desses valores. O índice que tem maior amplitude, conforme a Figura 4, é o CBOE VIX, que teve mínima de 12.70 e máxima de 60.13. Com essa exceção, constatamos que nenhum índice apresentou o ponto máximo do preço como o dobro ou mais do que o ponto mínimo, visto que nenhuma das variações estudadas supera 1 (máximo é o dobro do mínimo). A maioria está abaixo de 0.4, o que significa que a alta não chegou a valer 1.4 vezes a baixa.

Figura 4: Distribuição da oscilação máxima dos índices em relação ao preço mínimo das últimas 52 semanas, às 17 horas do dia 25 de Setembro de 2025.



5 Conclusão

A análise exploratória realizada permitiu observar padrões gerais do comportamento dos principais índices financeiros mundiais em 26 de setembro de 2025. Constatou-se que, embora a maioria dos índices tenha apresentado variações modestas em relação ao dia anterior, alguns indicadores, como o CBOE VIX e o índice da bolsa de Buenos Aires, exibiram movimentos mais expressivos. Além disso, a maior parte dos índices situou-se próxima às suas máximas anuais, sugerindo uma tendência geral de valorização no período recente. A avaliação das amplitudes entre os valores mínimos e máximos das últimas 52 semanas mostrou, por sua vez, que apenas poucos índices apresentaram oscilações significativamente elevadas.

Referências

- [1] Y. Finance, “World indices,” 2025, acesso em: 25 set. 2025. [Online]. Available: <https://finance.yahoo.com/markets/world-indices/>