

Tecnologia & Investimentos

Análise Fundamentalista + Machine Learning



Atomus Invest

SUMÁRIO



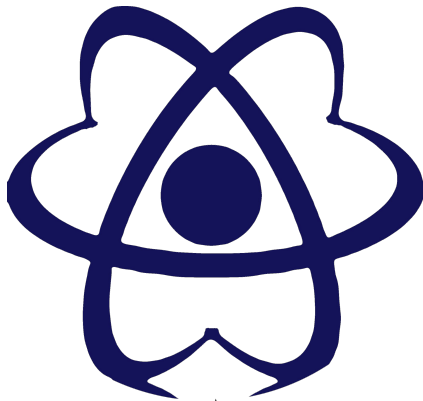
1. Projeto
2. Por que investir com a Atomus?
3. Nossos Resultados
4. Dúvidas

A wooden balance scale is shown against a blurred green background. On the left pan, there is a large burlap money bag with a large blue dollar sign (\$) on it, and a smaller, crumpled money bag next to it. On the right pan, there is a white silhouette of a family consisting of a man, a woman, and a child holding hands. The scale is perfectly balanced.

Valores:

- Educação Financeira
- Buy and Hold
- Preservação de Capital

#BeAtomus



Educação Financeira	Preservação de Capital	Buy and Hold
<p>Ajudar a desmistificar estratégias de investimento renomadas</p> <p>Democratização da informação</p>	<p>Diversificação inteligente</p> <p>Mentalidade de sócio e crescimento mútuo</p>	<p>Empresas Sólidas</p> <p>Longo Prazo</p>

- 
- **Análise Fundamentalista**
 - **Grandes Investidores**
 - **Machine Learning**





- Análises Fundamentalistas Históricas
- Comparação de múltiplos Ativos simultaneamente em tabelas Interativas



- Estratégias de Grandes Investidores Automatizadas
- Simulações de Portfólios Teóricos de Longo Prazo



- Machine Learning
- Grupos de Ações, baseados na afinidade das empresas entre si.

Históricos



	▲ ENBR3 Atual ♦	Med (19-11) ♦	Atual x Média ♦	Indicadores de Momento ♦
Div.Yield	3.17%	6.48%	-51.06%	Ruim
Div.Brut/ Patrim.	0.92	0.65	42.51%	Ruim
EV/EBIT	7.16	9.10	-21.34%	Barato
Liq. Corr.	1.09	1.16	-6.19%	Neutro
P/L	8.54	16.46	-48.12%	Barato
P/VP	1.13	1.37	-17.78%	Barato
PSR	0.76	1.66	-54.46%	Barato
ROE	13.23%	9.63%	37.31%	Bom
ROIC	10.10%	10.29%	-1.89%	Neutro

VS



	▲ ABEV3 Atual ♦	Med (19-13) ♦	Atual x Média ♦	Indicadores de Momento ♦
Div.Yield	3.68%	2.59%	41.93%	Bom
Div.Brut/ Patrim.	0.09	0.08	19.43%	Ruim
EV/EBIT	14.03	14.38	-2.44%	Neutro
Liq. Corr.	1.29	1.00	28.82%	Bom
P/L	24.13	23.19	4.06%	Neutro
P/VP	2.69	5.09	-47.11%	Barato
PSR	3.77	5.56	-32.20%	Barato
ROE	11.14%	23.71%	-53.01%	Ruim
ROIC	15.51%	28.12%	-44.84%	Ruim

Algoritmo de Valuation Fundamentalista



Papel ▲	Avaliação Atual ▼	Avaliação Histórica ▼	Momento ENBR3 ▼
ENBR3	8.5	8.0	Momento Bom

Análise Final ENBR3

- ✚ Bons fundamentos para o longo prazo, analisando pelos seus indicadores atuais.
- ✚ Bons fundamentos para o longo prazo, analisando pelos seus indicadores históricos.
- ✚ Empresa está descontada no momento em relação aos seus fundamentos, comparando indicadores atuais x históricos.

Algoritmo de Valuation Fundamentalista



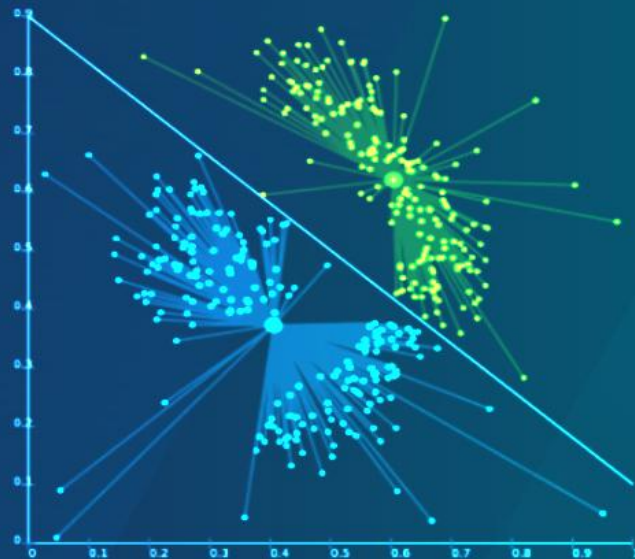
Papel ▲	Avaliação Atual ⬆	Avaliação Histórica ⬆	Momento ABEV3 ⬆
ABEV3	5.0	5.0	Momento Neutro

Análise Final ABEV3

- 📌 Fundamentos medianos para o longo prazo, analisando pelos seus indicadores atuais.
- 📌 Fundamentos medianos para o longo prazo, analisando pelos seus indicadores históricos.
- 📌 Empresa está neutra no momento em relação aos seus fundamentos, comparando indicadores atuais x históricos.

AFINAL,
O QUE É

CLUSTERIZAÇÃO?

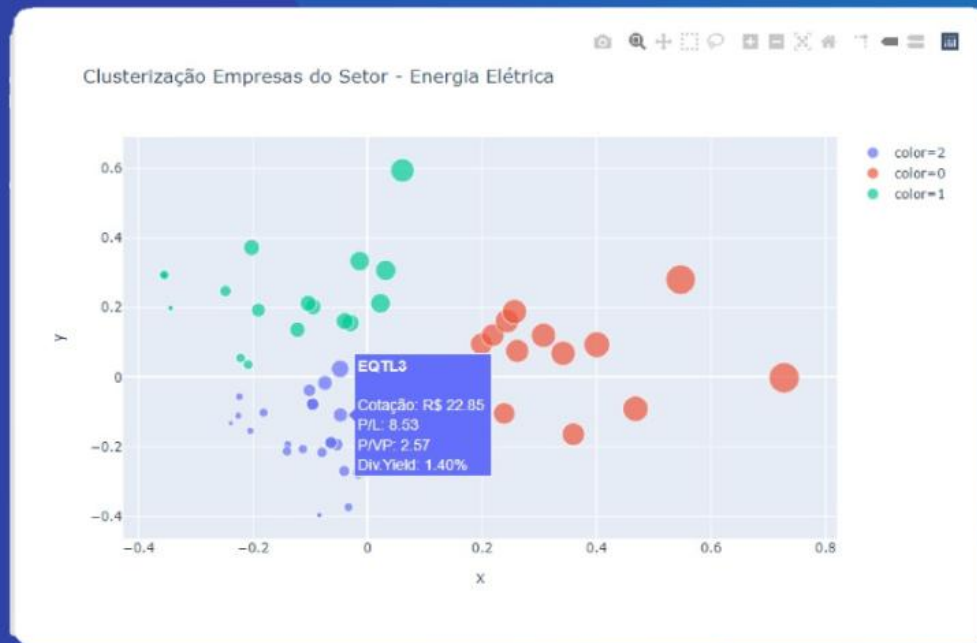


A Clusterização é um tipo de **aprendizado de máquina não supervisionado**.

Seu principal objetivo é **classificar dados** pertencentes à uma amostra **em grupos** que compartilham **características comuns**.



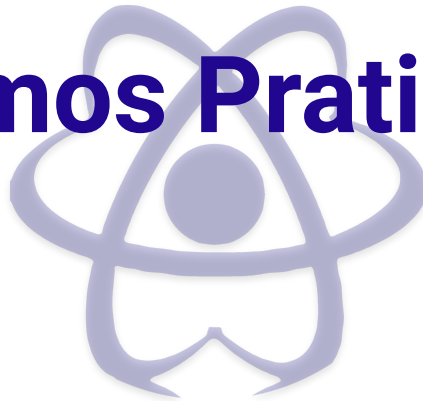
USAMOS ESTATÍSTICA E APRENDIZAGEM DE MÁQUINA PARA CLASSIFICAR AS AÇÕES EM GRUPOS ÚNICOS.



EMPRESAS COM **FUNDAMENTOS SEMELHANTES**
FICAM MAIS PRÓXIMAS.

E ASSIM, FORMAMOS **GRUPOS DE AÇÕES**
COM CARACTERÍSTICAS EM COMUM !

Vamos Praticar?



- **Pilares**
- **Performance**

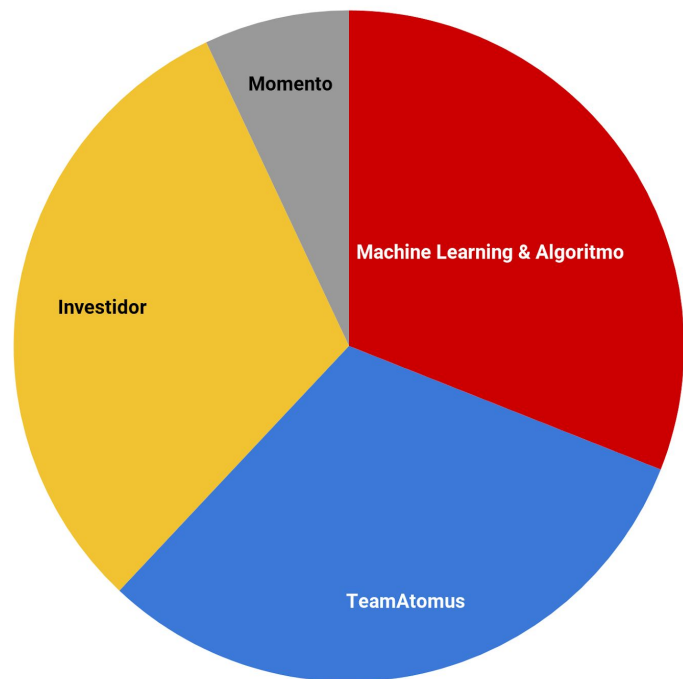


Atomus Invest

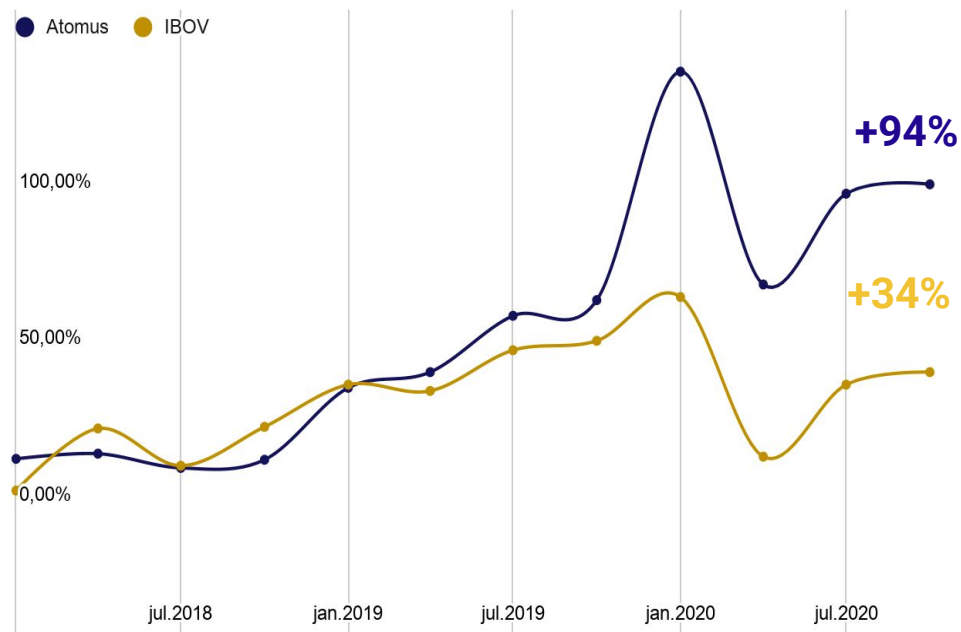
Business Strategy

Innovation
Branding
Solution
Marketing
Analysis
Ideas
Success
Management

Pilares



Performance







OBRIGADO!

contato@atomusinvest.com.br



**Victor
Santos**

Engenheiro de
Produto



**Gabriel
Souza**

Engenheiro de
Tecnologia