



UNIVERSIDADE FEDERAL DO RIO GRANDE DO SUL
ESCOLA DE ADMINISTRAÇÃO
DEPARTAMENTO DE CIÊNCIAS ADMINISTRATIVAS



Trabalho Final da Disciplina

Disciplina: ADP 343 – Análise de Dados Financeiros e Econômicos com o R

Professor: Marcelo S. Perlin

E-mail: marcelo.perlin@ufrgs.br

Datas importantes:

2015-12-15 apresentações

2015-12-15 entrega arquivos

Introdução

O trabalho final consiste na condução de um projeto piloto de pesquisa científica com base em dados reais e utilizando a plataforma R. A escolha do problema de pesquisa é livre, incluindo situações fora da alçada de finanças. Porém, o nível de dificuldade deve ser compatível com o aprendizado em sala de aula. Evitem projetos muito simples ou demasiadamente complexos, que não possam ser executados dentro do tempo esperado. Escolham um tema de pesquisa que seja desafiador e interessante, e que utilize as ferramentas aprendidas em sala de aula, incluindo econometria e simulação. Minha sugestão é que definam algo relacionado com a pesquisa em suas respectivas dissertações de mestrado e teses de doutorado. Dessa forma, será possível reaproveitar o trabalho em um ponto futuro no tempo.

Escolha dos Dados

Existem diversas bases de dados públicas que podem ser utilizadas para o trabalho. Aqueles alunos que não tiverem uma ideia clara do assunto da pesquisa, entrem em contato comigo que eu posso fornecer sugestões dentro da alçada de finanças e cientometria. Pessoalmente, tenho acesso a uma ampla base de dados, a qual pode ser disponibilizada. Isto inclui:

- ❖ Transações e ordens de ações e opções na Bovespa (intraday tick by tick ou agregados, x por x minutos);
- ❖ Preços e volumes de fechamento para ações na Bovespa e NYSE (diário, semanal ou mensal);
- ❖ Preços de diversos índices financeiros internacionais;
- ❖ Preços e yields de títulos públicos (Tesouro Direto);
- ❖ Dados financeiros sobre fundos de investimentos no Brasil;
- ❖ Base histórica de pesquisadores e publicações disponíveis na plataforma Lattes;
- ❖ Diversas outras disponíveis na internet.

Considerações sobre a Pesquisa

- O trabalho pode ser realizado em grupos de até dois integrantes. Aceitarei também trabalhos individuais;
- O trabalho de código deve ser entregue em formato [RMarkdown](#) (veja capítulo do livro) ou [Quarto](#) ;

- Uma apresentação oral será realizada, e arquivo de slides, também deverá ser enviada. A apresentação será conduzida com um tempo de 15-30 minutos por grupo e deve ser composta por três partes:
 - Detalhes da pesquisa: Introdução ao problema, objetivos, contribuições, dados utilizados, etc;
 - Código R: Apresentação do código e execução;
 - Resultados: Resultados encontrados na pesquisa, incluindo tabelas e gráficos.

Material a ser entregue

O trabalho em si deve ser entregue em um único arquivo até a data de apresentação via Moodle. O arquivo a ser entregue deve ser compactado em formato .zip, contendo os seguintes arquivos:

- ❖ Código da pesquisa (arquivo com extensão .qmd para quarto e .Rmd para Rmarkdown);
- ❖ Arquivos com os dados. Caso for uma base de dados proprietária, coloque apenas uma amostra. Se a base for grande e não couber em 15 MB do arquivo zipado, indique no código um link para baixar o arquivo de dados. Podes, por exemplo, usar o Google Drive ou Dropbox para compartilhar os dados na nuvem.
- ❖ Arquivo em html ou pdf com os slides a serem apresentados (veja as capacidades do RStudio em criar slides)