O trabalho tem o objetivo de analisar o comportamento da bolsa de valores brasileira (de um país emergente) e sua relação com indicadores macroeconômicos locais e também avaliar o comportamento desta com outros índices do mercado financeiro, tanto locais quanto internacionais durante as primeiras duas décadas do século XXI.

O trabalho propõe uma metodologia de estudo de séries temporais. Essa metodologia divide a análise em três fases. Na primeira fase são analisados os indicadores macroeconômicos do país e de que forma eles impactam na bolsa de valores. Busca-se definir intervalos temporais que apresentem grandes variações nos dados macroeconômicos para se estudar os impactos no índice de ações. Na segunda fase são realizadas comparações entre diferentes índices locais e internacionais com a bolsa brasileira, analisando-se de que forma eles refletem no resultado desta última. Por fim, é conduzido o teste de algumas hipóteses sobre o comportamento dos investidores da bolsa de valores e também é realizado alguns estudos estatísticos.

Os dados macroeconômicos foram obtidos a partir dos dados públicos do Banco Central do Brasil. Os dados com as cotações diárias dos índices de ações foram obtidos através da base de dados de uma plataforma de finanças online, investing.com. Ambos conjuntos de dados são formados por uma coluna com valores (cotações, preços, pontos) e um índice no formato datatime. A maioria dos dados foi coletado a partir do primeiro dia do ano 2001, para ser conduzido um estudo ao longo de duas décadas. As bases de dados que não existiam em 2001 foram baixadas a partir do primeiro dia em que foram criadas e ao longo do trabalho ajustes foram feitos para se comparar intervalos de tempo semelhantes.