**Universidade Presbiteriana Mackenzie**

**Integrantes:**

Paulo Cesar Masson Junior - 10416023

Luciano Guimaraes Costa - 10289655

Douglas Novaes Dias - 10423666

Rafael Jose de Oliveira – 10415375

**PROJETO APLICADO I – ANÁLISE B3**

**São Paulo**

**2024**

**SUMÁRIO**

# Contextualização do Problema

# Trajetória

# Problema Principal

# Solução

# Produtos

## Boi gordo

## Café Arábica Tipo 4/5

## Etanol Hidratado

## Milho

## Ouro

## Soja

# Base de Dados / Repositório do GitHub

# Cronograma

# 8 Aplicação

1. **CONTEXTUALIZAÇÃO DO PROBLEMA**

A **história da bolsa de valores brasileira** remonta ao período colonial, antes mesmo de o Brasil se tornar uma República. No final dessa fase, os diferentes estados brasileiros possuíam sua bolsa que servia para negociar os ativos de investidores. Com destaque para o **Rio de Janeiro e São Paulo**, as bolsas eram controladas por **órgãos governamentais**. As Secretarias de Finanças de cada estado da federação regulamentavam o funcionamento dos pregões.

Mas em **1966** **ocorreu uma reforma geral do sistema financeiro brasileiro**. Nessa época as bolsas passaram a ser entidades autônomas, com liberdade de funcionamento e fiscalizadas por órgãos regulamentadores. Assim, elas se tornaram um tipo de **associação civil sem fins lucrativos**, como funcionam as fundações, por exemplo. O próximo marco ocorreu na época do **Governo Militar**, mais precisamente nos anos **1970**. Nesse período, a bolsa de São Paulo começou a se destacar das demais.

**2. TRAJETÓRIA**

A trajetória da bolsa de São Paulo até a fusão com a B3 foi marcada por diversos acontecimentos importantes:

1. Na época do Governo Militar, nos anos 1970, a bolsa de São Paulo começou a se destacar das demais bolsas do país, tornando-se a maior bolsa de valores do Brasil.

2. Em 2000, a Bolsa de Valores de São Paulo (Bovespa) se fundiu com a bolsa de valores do Rio de Janeiro, abarcando todas as demais bolsas do país e passando a negociar todos os títulos privados e ações.

3. Em 2005, foi implantada a negociação eletrônica em todas as operações das bolsas de valores, e no ano seguinte, o pregão presencial foi oficialmente extinto, consolidando a integração da Bovespa e da bolsa do Rio de Janeiro como a maior bolsa de valores da América Latina. Esses eventos foram fundamentais na evolução da bolsa de São Paulo e no caminho que culminou na fusão com a Central de Custódia e Liquidação Financeira de Títulos Privados (CETIP) em 2017, formando a atual B3.

1. **PROBLEMA PRINCIPAL**

**Desenvolver medidas que aumentam transparência e a disponibilidade de informações para todos os participantes do mercado**.

Um problema que a Bolsa de Valores do Brasil (B3) enfrenta e que pode ser alvo de solução é a redução da assimetria de informações no mercado financeiro. **A assimetria de informação** ocorre quando uma das partes envolvidas em uma transação possui mais informações do que a outra, o que pode resultar em desequilíbrios e prejuízos para os investidores menos informados. **Para solucionar esse problema**, a B3 e outras bolsas de valores podem programar medidas que aumentem a transparência e a disponibilidade de informações para todos os participantes do mercado. Isso pode **incluir a divulgação de dados financeiros** e **operacionais mais detalhados**, a implementação de sistemas de monitoramento e controle mais eficazes e a promoção de educação financeira para os investidores.

Além disso, a adoção de tecnologias como **blockchain** e **inteligência artificial** pode ajudar a melhorar a segurança e a integridade das transações, reduzindo a possibilidade de fraudes e manipulação do mercado.

**Em resumo, a redução da assimetria de informações na B3 é um problema importante a ser enfrentado para garantir um mercado financeiro mais justo, transparente e eficiente.**

1. **SOLUÇÃO**

Devido a **Assimetria de informação** propomos construir um acompanhamento diário de fácil visualização e entendimento referente as variações de preços das principais comodities oferecidas pela **B3**, estes produtos serão apresentados logo em seguida.

Com nossa análise conseguimos traçar um entendimento evolutivos através da evolução histórica, sendo possível efetuarmos algumas previsões e projeções a fim de determinar o melhor momento de venda de cada produto no qual serão analisados.

Tal análise facilitara os produtores agrícolas e pecuários a maximizar suas produções e aumentar a geração e receita, visto que será possível analisar diariamente os índices de:

* Preço mínimo
* Preço máximo
* Preço médio
* Preço de fechamento
* Oscilação
* Número de negócios
* Quantidade de contratos negociados
* Volume financeiro

1. **PRODUTOS**

***5.1 Boi Gordo***

Interface gráfica do usuário, Texto, Aplicativo, Email

Descrição gerada automaticamente

***5.2 Café Arábica Tipo 4/5***

Interface gráfica do usuário, Texto, Aplicativo, Email

Descrição gerada automaticamente

***5.3 Etanol Hidratado***

Interface gráfica do usuário, Texto, Aplicativo, Email

Descrição gerada automaticamente

***5.4 Milho***

Interface gráfica do usuário, Texto, Aplicativo, Email

Descrição gerada automaticamente

***5.5 Ouro***

Interface gráfica do usuário, Texto, Aplicativo, Email

Descrição gerada automaticamente

***5.6 Soja***Interface gráfica do usuário, Texto, Aplicativo, Email

Descrição gerada automaticamente

1. **BASE DE DADOS**

Interface gráfica do usuário, Aplicativo

Descrição gerada automaticamente

**Links das bases de dados:**  
[Dados públicos de produtos listados e de balcão | B3](https://www.b3.com.br/pt_br/market-data-e-indices/servicos-de-dados/market-data/consultas/boletim-diario/dados-publicos-de-produtos-listados-e-de-balcao/)  
[Negócios Consolidados do Pregão (Listado) (1) (b3.com.br)](https://arquivos.b3.com.br/tabelas/TradeInformationConsolidated/2024-03-01?lang=pt)

**Link para acesso ao GitHub:**[pcmassonjr/ProjetoAplicado (github.com)](https://github.com/pcmassonjr/ProjetoAplicado)

1. **CRONOGRAMA**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **DATA PREVISTA** | **DESCRIÇÂO DA ATIVIDADE** | **RESPONSÀVEL** |
| MARÇO | 06/03/2024 - Projeto com base do que será desenvolvido Montaremos a base de dados através dos boletins diários da Bovespa, ou, por meio de plataformas como Economatica ou Terminal Bloomberg para extração dos dados. Em seguida, daremos inicio ás análises para investigar a possibilidade de resolver assimetrias de informações. Para isso, propomos uma abordagem analítica baseada em análise exploratória dos diversos dados coletados. | Base de Dados: Paulo Masson Documentação: Rafael Oliveira Restante das atividades: Todo o grupo |
| ABRIL | Realizaremos o (data storytelling) demonstrando a aplicação da análise para reduzir a assimetria de informações, utilizando os resultados analíticos como base. | Todo o Grupo |
| MAIO | Realizaremos os ajustes finais propostos juntamente com a apresentação dos resultados; | Todo o Grupo |

1. **Aplicação**

Gráfico, Gráfico de linhas

Descrição gerada automaticamente

Fig. 1 – Valor mínimo praticado em Março/2024

Gráfico, Gráfico de linhas

Descrição gerada automaticamente

Fig. 2 = Valor máximo praticado em Março/2024

Gráfico, Gráfico de barras

Descrição gerada automaticamente

Fig.3 – TradQty por AsstDesc - Março/2024

Gráfico, Gráfico de barras, Gráfico de caixa estreita

Descrição gerada automaticamente Fig.4 NtlFinVol por AsstDEsc Março/2024

Devido à falta de uma base de dados abrangente com mais de 10 anos, tendo apenas a base de março de 2024, notamos que não houve flutuação significativa nos preços das commodities:

**Boi Gordo** - Em plena safra, os preços permanecem remanescentes, principalmente em seus principais mercados, como São Paulo. Isso deve, em parte, ao mercado chinês, que não apresentou variações significativas nos preços. Essa situação pode mudar a partir de abril, com o início da entressafra.

**Café Arábica** - Embora o preço do café tenha tido uma recuperação nos últimos anos, houve oscilações em março, que se recuperaram no final do mês devido às variações climáticas. Os estoques de café têm restrições de forma geral, o que dificulta uma valorização expressiva dos preços.

**Etanol** - No final da colheita da safra, a Índia teve uma boa colheita. Os preços do etanol se recuperaram no final de março devido à expectativa de baixa produtividade futura, devido às variações de clima seco e baixa chuva.

**Milho** - Houve uma expansão no mercado de milho de 2023 para 2024, devido à melhora nos preços das commodities, o que influenciou na queda do preço. No entanto, devido à quantidade de chuva em janeiro nos mercados produtores, houve uma melhoria no preço. A recomendação é não vender agora, pois os preços devem ser recuperados no segundo semestre.

**Ouro** - O preço do ouro permanece estável, sendo utilizado como reserva em tempos de crise. No entanto, devido às instabilidades geopolíticas, o preço teve grandes flutuações. O mercado aposta na intensificação da crise entre China e EUA para a valorização futura do ouro.

**Soja** - Os estoques de soja são altos, o que não repercute no preço em baixo. As perspectivas para a soja não são boas devido à safra e aos estoques indicados. A tendência é que o preço caia nos próximos meses.