Projeto Setores Perenes

,
Obrigatório – README e Apresentação Gráfica
Buscar dados
Brasil
Ibovespa
Empresas do Ibovespa
BMF Ibovespa
**Série histórica do clima de T.O.
EUA
S&P 500
Dow Jones
Nasdaq
**Índice de preço da @ de boi
Crypto
Bitcoin
Etherium
YFinance
Setores perenes são realmente bons investimentos em períodos de instabilidade
Setores perenes

Setores necessários para a sobrevivência de um país

Carteira de renda mensal – recomendada pelo Barsi

Setores que estejam melhor remunerando seus acionistas (**dividendos**), mas levando em consideração a característica desses setores.

Principal característica é a **perenidade**. Setores que permanecem vivos por longos períodos de tempo. Seus produtos ou serviços são tão essenciais que a demanda será sempre crescente ou pelo menos estável em períodos de crise. Setores estáveis e resilientes.

Setores

- Energia elétrica
 - Geração, transmissão e distribuição
 - Bem que se paga sem consumir para que o benefício seja o mais completo possível
 - Alupar ALUP11
 - AES Brasil AESB3
 - Centrais Elétrica de Santa Catarina (Celesc) CLSC3
 - Cemig CMIG4
 - Eletrobras ELET3
 - Taesa TAEE11
 - https://blog.toroinvestimentos.com.br/bolsa/acoes-deenergia#:~:text=As%20principais%20a%C3%A7%C3%B5es%20d e%20empresas,%C3%94mega%2C%20Taesa%20e%20Transmi ss%C3%A3o%20Paulista.
 - Setembro 2022
- Sistema financeiro
 - Banco do Brasil BBAS3
 - Bradesco BBDC4
 - Itaú Unibanco ITUB4
 - Santander SANB11
 - https://blog.toroinvestimentos.com.br/bolsa/acoes-debancos#:~:text=As%20a%C3%A7%C3%B5es%20de%20bancos %20mais,BTG%2C%20Banrisul%20e%20Banco%20Pan.
 - Setembro 2022
- Sistema de Telecomunicações
- Saneamento básico

Outra característica é o grau de **sustentabilidade**, com um histórico de contemplar o acionista de modo mais gratificante.

Sustentabilidade – possa oferecer um bom projeto

Carteira Previdenciária – carteira de renda mensal – pautada em quatro pilares

Setores Perenes – setores

Empresas perenes – empresas que se mantém em alta durante muito tempo

Dividendos – empresas que contemplem os acionistas de forma mais gratificante

Sustentatbilidade e Bons projetos – conceitos um pouco mais subjetivos

ETF – Exchange Traded Fund

Fundo de investimento é uma modalidade coletiva de aplicação. O gesto aplica o capital dos cotistas seguindo uma proposta de investimento.

São Fundos de Investimento que aplicam seus recursos em várias ações negociadas na bolsa

Ao investir no fundo você está investindo em um grupo de ativos sem precisar comprar cada ativo individualmente.

Ibovespa

Carteira teórica das ações mais negociadas na Bolsa brasileira. Sua composição é reavaliada a cada quatro meses.

Representa cerca de 80% do volume de negócios em cada pregão. A quantidade de ativos varia, mas se mantém em torno de 90 ações. 22% das ações da Bolsa representam 80% do volume de negociações.

Mede o desempenho das ações mais negociadas pelos investidores em um determinado período.

Ibovespa tende a ser mais concentrado, ou seja, empresas grandes (Vale e Petrobrás) tendem a apresentar grande porcentagem na composição.

IBrX 50 & 100

Índice composto exclusivamente por ações e units de empresas brasileira, descartando a presença de BDRs e FIIs.

Mais diversificado que o Ibovespa

Bolsas Americanas

Abertura 9h30 – horário local

Fechamento 16h - horário local

Ações preferenciais

As ações preferenciais, como o nome indica dão preferência ao pagamento de direitos: dividendos, juros sobre capital próprio e, inclusive, caso a empresa vá à falência, os acionistas com ações preferenciais têm direito de serem pagos antecipadamente. Mais liquidez

Ações ordinárias

As ações ordinárias do Itaú (ITUB3) também têm direito a dividendos e outros proventos, porém, elas não têm a preferência no recebimento. O diferencial das ações ordinárias é que elas dão direito a voto em assembleias da empresa. São especiais pra quem quer participar dos rumos da empresa.

Ações Units

Utilities

An organization supplying the community with electricity, gas, water, or sewerage.

Índices disponíveis na B3

IBOV: Índice Bovespa - É o principal indicador de desempenho das ações negociadas na B3 e reúne as empresas mais importantes do mercado de capitais brasileiro

IBXX: Índice IBrX 100 - 100 ativos de maior negociabilidade e representatividade do mercado de ações brasileiro.

IBXL: Índice IBrX 50 - 50 ativos de maior negociabilidade e representatividade do mercado de ações brasileiro.

IBRA: Índice Brasil Amplo - O objetivo do IBrA é ser o indicador do desempenho médio das cotações de todos os ativos negociados no mercado a vista (lotepadrão) da B3 que atendam a critérios mínimos de liquidez e presença em pregão, de forma a oferecer uma visão ampla do mercado acionário.

IFNC: Índice Financeiro - ativos de maior negociabilidade e representatividade dos setores de intermediários financeiros, serviços financeiros diversos, previdência e seguros.

ICON: Índice de Consumo - ativos de maior negociabilidade e representatividade dos setores de consumo cíclico, consumo não cíclico e saúde.

IEEX: Índice de Energia Elétrica - ativos de maior negociabilidade e representatividade do setor de energia elétrica.

IFIX: Índice de Fundos Imobiliários - Fundos imobiliários negociados nos mercados de bolsa e de balcão organizado da B3.

IFIL: Índice de Fundos Imobiliários de Alta Liquidez - Fundos imobiliários mais líquidos negociados nos mercados de bolsa e de balcão organizado da B3.

IMAT: Índice de Materiais Básicos - ativos de maior negociabilidade e representatividade do setor de materiais básicos.

IDIV: Índice Dividendos - ativos que se destacaram em termos de remuneração dos investidores, sob a forma de dividendos e juros sobre o capital próprio.

INDX: Índice do Setor Industrial - ativos de maior negociabilidade e representatividade dos setores da atividade industrial compreendidos por materiais básicos, bens industriais, consumo cíclico, consumo não cíclico, tecnologia da informação e saúde.

IMOB: Índice Imobiliário - ativos de maior negociabilidade e representatividade dos setores da atividade imobiliária compreendidos por exploração de imóveis e construção civil.

MLCX: Índice MidLarge Cap - ativos de uma carteira composta pelas empresas de maior capitalização.

SMLL: Índice Small Cap - empresas de menor capitalização.

UTIL: Índice Utilidade Pública - ativos de maior negociabilidade e representatividade do setor de utilidade pública (energia elétrica, água e saneamento e gás).

IVBX: Indice Valor empresas bem conceituadas pelos investidores.

ChromeDriver

Instalado e salvo na pasta do anaconda

CONSTRUINDO O CÓDIGO

DataFrame IBOVESPA

Read_csv argumentos

- Skipfootet = num quantidades de linhas inferiores a serem removidas do DataFrame
- Index_col = false n\u00e3o faz com que a primeira coluna seja o \u00eandice do DataFrame

Como unir os DataFrames já que as datas são diferentes?

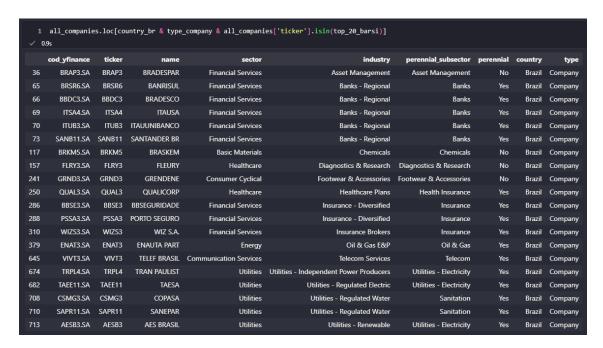
Utilizar pd.map para preencher nome do índice condicionalmente

```
1 all_companies.loc[perennial & country_usa, 'perennial_subsector'].value_counts()

v 0.9s

Utilities - Electricity 27
Insurance 23
Oil & Gas 23
Banks 18
Health Insurance 7
Telecom 7
Sanitation 3
Utilities - Gas 2
Name: perennial_subsector, dtype: int64
```

Carteira Barsi



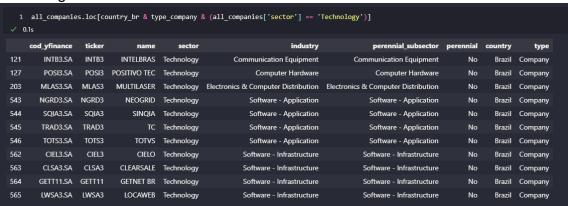
16 Perenes

4 Não perenes

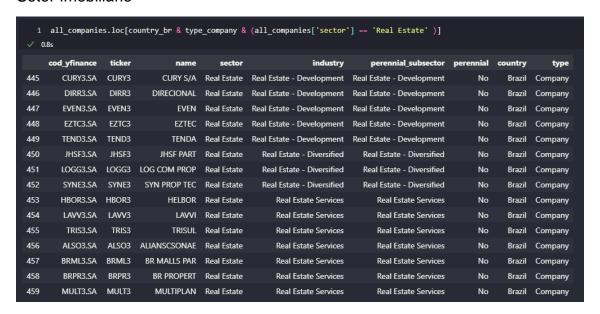
- Chemicals
- Asset Management
- Specialty Retail
- Footwear & Accessories

Banks	5
Insurance	3
Utilities - Electricity	3
Sanitation	2
Asset Management	1
Chemicals	1
Footwear & Accessories	1
Health Insurance	1
Oil & Gas	1
Specialty Retail	1
Telecom	1
Name: perennial_subsector,	dtype: int64

Tecnologia



Setor Imobiliário



Apresentação

Capa

Bom dia, pessoal, meu nome é Pedro eu meu projeto é uma análise do mercado financeiro, com o foco em comparar os setores perenes da economia com o demais setores.

Disclaimer – não sou especialista no assunto, longe disso. Foi só uma curiosidade que eu tive e já vou explicar o porque

Índice

Essa apresentação vai seguir este roteiro

Introdução

Quando eu vou começar a estudar um assunto, eu procuro aprender com os melhores da área. Em se tratando de investimento

Esse rapaz é o Luiz Barsi Filho, o maior investidor individual do Brasil, seu patrimônio é estimado em R\$ 2 Bilhões em ações e sua estratégia de investimento é a carteira previdenciária – uma carteira focada em renda mensal e longo prazo – pautada em 4 pilares

Setores perenes da economia - Empresas perenes – empresas que se mantém em alta durante muito tempo

Dividendos – empresas que contemplem os acionistas de forma mais gratificante

Sustentabilidade – empresas cujas atividades são sustentáveis

Bons projetos – empresas que apresentem bons projetos para o futuro

Sustentatbilidade e Bons projetos – conceitos um pouco mais subjetivos

Pergunta de Negócio

Sustentabilididade e bons projetos requerem uma análise mais aprofundada de cada empresa, a questão de dividendos também.

Então eu resolvi focar na questão dos setores perenes

Base de Dados

O que eu preciso para fazer minha análise

Primeiro eu preciso saber quais empresas e índices eu vou utilizar. No B rasil o índice mais famoso é o Ibovespa, pensei em pegar as empresas contempladas por este índice, mas achei que 92 empresas seria pouco para a análise, então decidi pegar as empresas listadas no IBRA

Já nos EUA, eu peguei um total de 520 empresas, que estão listadas no 3 maiores índices. Estes índices juntos contemplam um total de 525 empresas

Para as empresas brasileiras eu busquei no site da B3 que é a nossa bolsa de valores, muito bem organizado o site deles, tinha vários índices e suas composições.

Para as americanas eu tive que recorrer à Wikipedia.

Ibovespa – índice mais importante do Brasil - É formado pelas ações com maior volume negociado nos últimos meses.

IBRA – 200 maiores empresas do Braisl

S&P 500 - 500 maiores empresas dos EUA

Nasdaq 100 – 100 maiores empresas da bolsa Nasdaq

Dow Jones – 30 grandes emprsas

Características das empresas

B3 e Wikipedia - forneceu os setores e indústria das empresas, mas não estava padronizado –

A minha estratégia, foi buscar no site do Yfinance, um site estruturado em torno do mercado financeiro. Lá eu encontrei o setor e a indústria de todas as empresas.

API – mecanismo que facilita a interface com as informações do site

Duas tabelas – uma com as series históricas e outra com as características das empresas

Tratamento dos dados

Fazer a seleção da industrias que fazem parte do Bancos Energia Seguros Saneamento e Telecom

Subdivisões do setores

Depois do tratamento esse dados foram colocados no SQL – banco de dados

Série histórica

Atualização dos dados

Eu tinha que encontrar uma maneira de automatizar esse processo

Separar as etapas do processo em funções no Python

Registrar o processamento do código, tanto o que ocorre da maneira desejada quanto os erros

Análise Exploratória

Examinar e estudar as características de um conjunto de dados antes de que ele seja submetido a uma aplicação

Desbalanceados no sentido dos setores, industrias, países

Muito mais empresas americanas, e setores não perenes

Outra questão é que a quantidade de empresas varia a o longo do tempo, ao longo dos anos mais empresas vão sendo criadas e/ou adicionadas ao índice

Sempre nos incentiva a utilizar gráficos de pizza

Brazil 2019

A conclusão da avaliação dos preços em períodos de cries é que as empresas seguem o mesmo padrão em escalas diferentes.

Os setores perenes são menos voláteis

A filha do Barsi tem uma empresa que faz análises de mercado financeiro voltado para a estratégia do pai, eu selecionei um top 20 de empresas indicadas por eles e que estavam presentes nessa base de dados

Se a gente for analisar esse período curto de tempo, a carteira teve um desempenho parecido com a Ibovespa

Brazil 2012

Numa escala maior de 10 anos, a carteira previdenciária fica mais atrativa

Em períodos de crise, o comportamento do **preço** das ações é parecido

USA 2019

Setor de tecnologia é muito mais volátil. Todos seguem o mesmo padrão em escalas diferentes

Os preços das ações acompanham o mercado de forma parecida

Perspective Change

01/01/2008

10/10/2017