

DSG 2018





O PROBLEMA

Visão Geral



Interesse de compra e venda de produtos no mercado de títulos corporativos



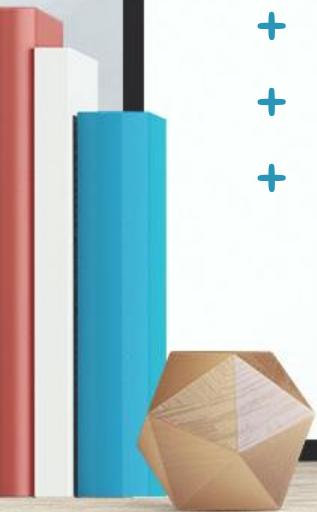


CUSTOMER

Informações sobre cada cliente

CUSTOMER

- + CustomerIdx: index atribuido ao Cliente
- + Sector: o setor que o Cliente ocupa
- + Subsector: o sub-setor que o cliente ocupa
- + Region: ?
- + Country: País de atuação do cliente





ISIN

Informação sobre cada título

ISIN

- + IsinIdx: index atribuido ao Titulo
- + TickerIdx: index atribuido ao emissor do título
- + IssueDateKey: a data de emissão do título
- + ActualMaturityDateKey: a data de vencimento (após isso ela deve ser renovada ou deixa de existir) de um título
- + Currency: a moeda a qual o título pertence

ISIN

- + Seniority: ordem de reembolso em caso de venda ou falencia do emitente
- + IssuedAmount: quanto do título foi emitido na atual moeda



ISIN

- + CouponType:

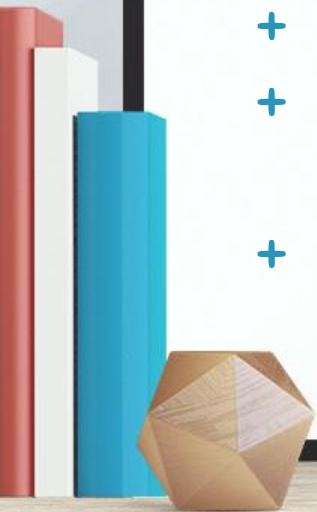
Coupon:

Um pagamento de cupom em um título é o pagamento de juros anual que o detentor de bônus recebe da data de emissão do título até o vencimento.



ISIN

- + Fixed: Carrega uma taxa de juros predeterminada.
- + Floating: Aumenta a cada período
- + Step Cpn: Taxa mais alta nos períodos seguintes ao primeiro
- + Zero Coupon: Taxa deve ser paga no momento do vencimento



ISIN

- + CompositeRating: É a nota que empresas especializadas são ao título sendo AAA a melhor e D a pior, com NR as sem nota
- + MarketIssue: Classificação do mercado para o título – MTN: nota de médio prazo com vencimento de 5 a 10 anos



ISIN

- + IndustrySector: tipo de setor do emissor
- + IndustrySubgroup: mais detalhes sobre o setor do emissor
- + ActivityGroup:
 - FLOW G10: Países do G10
 - FLOW LOCAL MARKET: Mercado Local
 - SAS & COVERED BONDS: Atividades SupraNacionais e obrigações cobertas

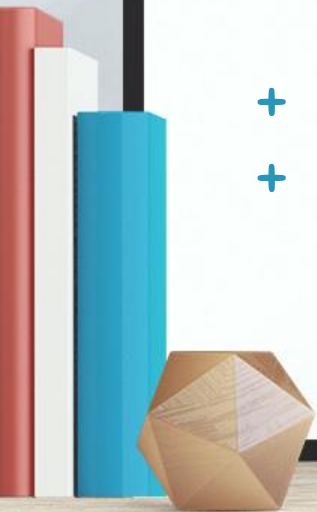


MARKET

Informação sobre histórico de preços
dos títulos

MARKET

- + IsinIdx: o index do título
- + DateKey: data em que os valores estavam em vigor
- + Price: preço do título em porcentagem
- + Yield: rendimento do título em porcentagem, é o valor anual esperado de retorno do investimento



MARKET

- + ZSpread: Diferença entre o rendimento e a taxa livre de risco (interesse que um investidor esperaria de um investimento absolutamente livre de risco) expressa em porcentagem





MACRO MARKET

Informação sobre Curva de
rendimento, câmbio estrangeiro e
capital próprio



MACRO MARKET

- + DateKey: data de análise (todos os dias exceto fins de semana)
- + Equity: principais índices de ações, conforme cotados na bolsa de câmbio correspondente.
- + Foreing Exchange: valor do dolar expresso nas outras moedas do mundo



MACRO MARKET

- + As outras colunas simbolizam o nível de taxa de juros interbancário garantido (taxa livre de risco)
- + `Swap(Modelo)_JPY(Moeda)5Y(Tempo)`



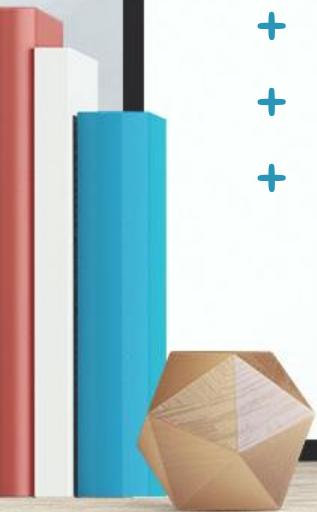


TRADE

Comércio que ocorreu durante os anos

TRADE

- + TradeDateKey: data em que a transação ocorreu
- + CustomerIdx: index atribuido ao cliente
- + IsinIdx: index atribuido ao titulo
- + BuySell: Intenção do cliente de Vender ou Comprar



TRADE

- + NotionalEUR: Valor nominal usado para calcular os pagamentos feitos em euro
- + Price: Preço proposta para a transação em porcentagem



TRADE

- + TradeStatus:

Done: Houve transação entre as partes

NotTraded: O cliente olhou o preço mas decidiu não fechar negócio

Unknown: O cliente enviou requisição mas não houve resposta

IOI: Cliente demonstrou interesse em uma transação futura



TRADE

- + TradeStatus:
Holding: Informação regular da situação financeira do cliente em relação aos títulos. Apenas para representar as participações do cliente (sem transação real)
- + Interesse do Cliente: Done, NotTraded, Unknown ou IOI = 1, caso contrário = 0



CHALLENGE

Fazer previsão dos itens

CHALLENGE

- + PredictionIdx: index da predição
- + DateKey: data da troca (representando toda a semana do dia 23/04/2018)
- + CustomerIdx: index do cliente
- + IsinIdx: index do título
- + BuySell: Interesse em compra ou venda
- + CustomerInterest: Taxa de interesse a se prever