



Definição do projeto

Descrição do documento

O presente documento descreve a equipe "Winx Pistola" participante do módulo Arara Azul do programa de capacitação Pantanal.dev, bem como os detalhes (contexto, motivação e objetivo) do projeto que a equipe se propõe a trabalhar. O documento está organizado em seções: a primeira seção contém informações sobre a equipe - nome e integrantes; a segunda seção contém informações sobre o projeto.

Equipe

A equipe "Winx Pistola" é composta por quatro integrantes: Lucas Henrique Alves Borth, Júlia Alves Corazza, Murilo Matias da Silva e Pedro Rodrigues Arantes de Oliveira.

Projeto

A proposta do projeto consiste em analisar o impacto de notícias na compra/venda de ativos. Uma operação muito importante e atrativa no mercado financeiro é a compra e venda de ações. É potencialmente lucrativa, embora existam diversos fatores a se considerar para compreender a dinâmica dos ativos. Além disso, é necessário contemplar a volatilidade do mercado financeiro, fortemente impactado por notícias de diversas naturezas - desde de cunho político-econômico e financeiro até sanitário, verdadeiras ou não.

A pandemia da COVID-19 afetou significativamente o mercado financeiro mundial, de modo a gerar incertezas e volatilidades sem precedentes. O surgimento do vírus no final de 2019 na China e sua rápida disseminação pelo globo resultaram em lockdowns e em restrições em diversos países para tentar conter seu avanço, com impacto direto e significativo na economia global.

Em um primeiro momento, ocorreu uma queda brusca nos mercados financeiros em março de 2020: índices de ações e preço do petróleo despencaram vertiginosamente. Os investidores, com a perspectiva de uma recessão global, realizaram diversas operações de compra e vendas de ativos que culminaram no aumento na volatilidade do mercado e na demanda por ativos de baixo risco, como títulos do Tesouro dos EUA.

À medida que a pandemia se estendia, uma nova dinâmica se erguia no contexto financeiro: por um lado, as consequências econômicas se agravavam, com muitas empresas sofrendo dificuldades financeiras e demissões em massa; por outro, certas organizações - a se citar as de tecnologia - se beneficiaram com a crise, com a popularização e crescimento do home-office, o que levou a uma maior demanda por serviços de internet, streaming e teleconferência.



Serviço Público Federal
Ministério da Educação

Fundação Universidade Federal de Mato Grosso do Sul



A intervenção dos governos também teve um papel importante em atenuar os efeitos negativos da pandemia sobre o mercado financeiro. Muitos países implementaram pacotes de estímulo econômico para apoiar empresas e indivíduos afetados pela crise, além de medidas para injetar liquidez no mercado financeiro, como a minimização de taxas de juros e compra de títulos do Tesouro e corporativos.

Assim, após notícias de grande impacto, preços de ações podem oscilar significativamente devido a efeitos “manada” de compra e venda. Investidores, receosos, realizam uma operação que poderia ser feita em um momento mais oportuno. Nesse sentido, uma inteligência artificial que pudesse analisar o impacto das notícias fornece conhecimento probabilístico para que o investidor analise se ocorrerá ou está ocorrendo um efeito manada e deve aguardar que o mercado se regule para realizar uma operação. Com isso, o investidor teria aparato para melhorar sua especulação de ativos e possivelmente aumentar seu lucro.