

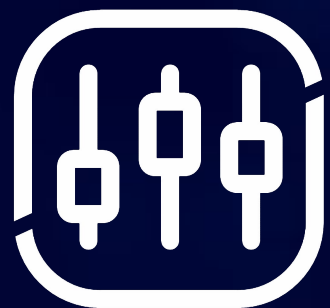
Trading com Dados

Artificial Intelligence for Financial Markets



Conceitos Macroeconômicos com Python





Trading com Dados

Artificial Intelligence for Financial Markets



Agenda

- Apresentação
- Quandl e Nasdaq DataLink
- Explorando a biblioteca
- Parte 1 Hands On: Indicadores Macroeconômicos com Python
 - PIB
 - Selic
 - IPCA
 - INCC
 - índices de Confiança



O que são indicadores macro?

- indicadores sobre estatísticas oficiais do governo
- auxilia a medir quantitativamente seu desempenho e a eficiência de políticas públicas
- ajuda o governo a tomar decisões importantes que impactam diretamente a vida das empresas e das famílias



PIB - Produto Interno Bruto

- $PIB = C + I + G + X - M$
- Principal métrica de atividade econômica nacional
- Somatório de todos os bens e serviços **produzidos**
- Quem apura: IBGE
- Medidor de fluxo econômico e não de riqueza



Selic - Taxa de Juros

- Taxa básica de juros da economia brasileira
- COPOM e a política monetária
- Afeta diretamente o crédito: empréstimos e financiamentos
- Custo de oportunidade e valuation das empresa



IPCA - Índice de Preços ao Consumidor Amplo

- Métrica principal para a *inflação* no país
- Reajuste de contratos
- Órgão responsável: IBGE
- Calculado a variação dos preços mês a mês
- Amostra: cesta de produtos



IGP-M: Índice Geral de Preços de Mercado

- Indexador dos aluguéis
- Serve para *reajustar contratos também de energia elétrica*
- Órgão responsável: FGV
- Calculado a variação dos preços mês a mês
- IPA-M / IPC-M/ INCC-M



INCC - Índice Nacional do Custo da Construção

- Afeta o custo dos insumos e da mão de obra no setor da construção civil
- Cobrança de parcelamento de empreendimentos
- É um dos componentes do Índice Geral de Preços
- Calculado a partir de 7 cidades (São Paulo, Rio de Janeiro, Brasília, Porto Alegre, Belo Horizonte, Salvador e Recife)
- Órgão responsável: FGV





Renda Variável no mercado financeiro



Renda Variável

Investimento em que não há conhecimento prévio dos rendimentos do futuro, e seu valor final pode assumir valores iguais, superiores ou inferiores ao da aplicação inicial.*

Exemplos: ações, FIIs, ETFs, BDRs

**Mercado de Capitais, Juliano Lima Pinheiro (2014)*



Ações

“Título de propriedade de uma parte do capital social da empresa que as emitiu”

Mercado de Capitais, Juliano Lima Pinheiro (2014)

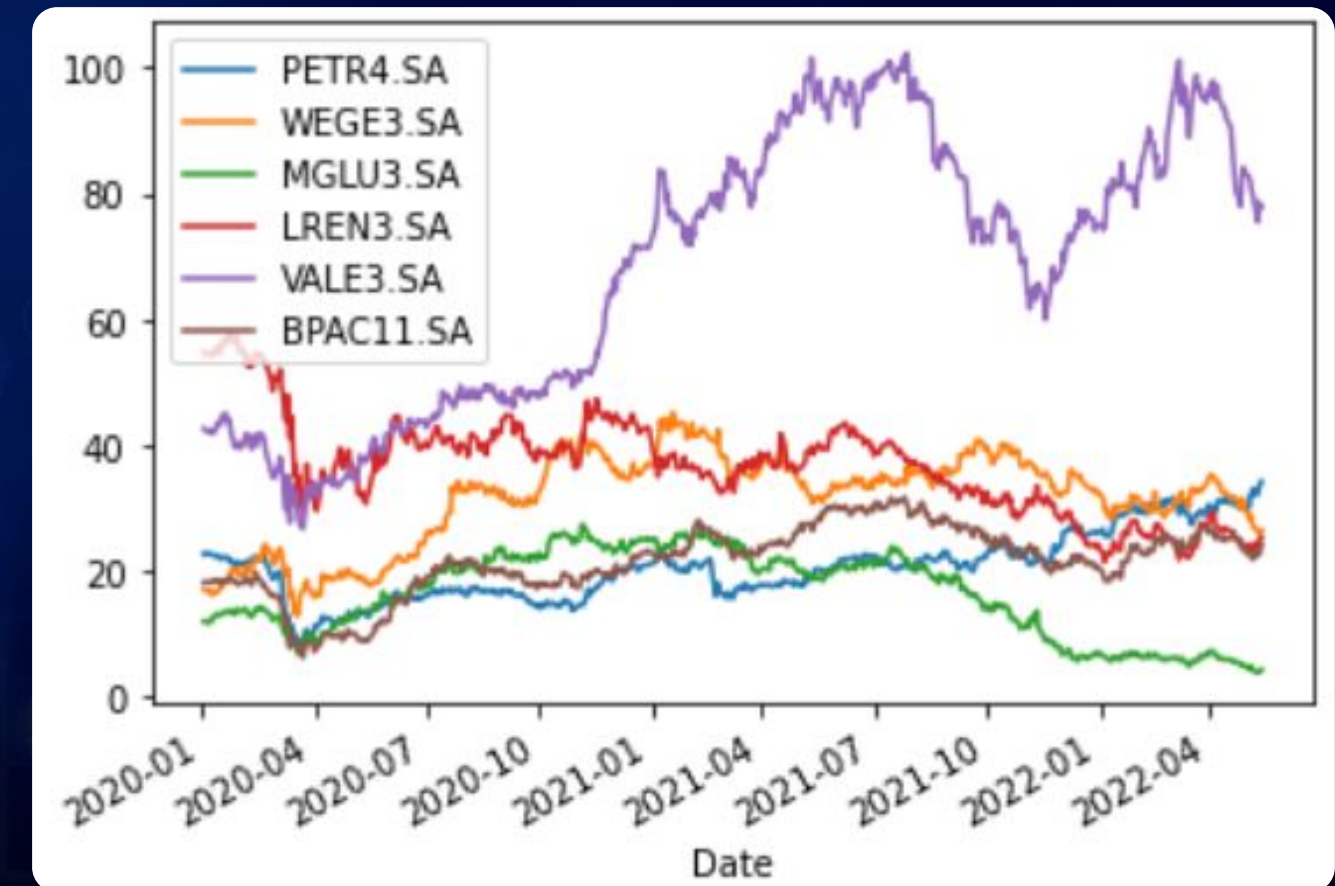


Tipos de ações

Ações ordinárias: têm como principal característica o direito a voto

Ações preferenciais: têm prioridade sobre as ações ordinárias no recebimento de dividendos e no caso de dissolução da sociedade

Units: certificados de depósito que pode combinar diferentes tipos de ativos para negociação em conjunto



ADRs e BDRs

ADR (American Depositary Receipts): Recibo representativo de uma ação de uma empresa estrangeira que se encontra depositada no banco do país de origem, no caso EUA.

BDR (Brazilian Depositary Receipts): Certificados representativos de emissão de companhias abertas com sede no exterior e emitidos por instituições depositárias no Brasil.



ETFs

Exchange Traded Fund: é um ativo que busca representar o desempenho de um índice através de sua composição. Um ETF é composto de vários ativos que buscam simular o desempenho desse índice.



Fundos de investimento

Fundos de investimento são aplicações realizadas de maneira coletiva, onde os gestores captam esses recursos com terceiros e ficam responsáveis pela sua administração. Cada fundo tem seu regulamento e diretrizes de risco. Podem existir fundos de renda fixa e de renda variável e sua gestão pode ser classificada em:

- Passiva: o gestor tem como objetivo de retorno como um benchark (CDI, IBOV)
- - Ativa: o gestor tem como objetivo superar o benchmark de referência



FIIs

- Fundos imobiliários são fundos de investimento que possuem ativos do setor. Funciona como uma espécie de condomínio: investidores que fornecem recursos para a aquisição e gestão de imóveis.
- Ao adquiri-las, o investidor passa a ter direito de participar dos rendimentos do fundo;
- A quantidade de proventos recebidos é proporcional ao número de cotas adquiridas;
- Funciona como uma boa alternativa ao investimento direto em imóveis.



