

Aplicação do Modelo Box e Jenkins para Análise do Ibovespa no Período de 2009 a 2013

Altiérez de Oliveira Silva^{1 4}

Gislene Araujo Pereira^{2 4}

Leticia Lima Milani^{3 4}

O índice da Bolsa de Valores de São Paulo (Ibovespa) é o mais importante indicador do desempenho das cotações das ações negociadas no mercado acionário, ele reflete o comportamento dos investimentos em ações e em consequência, algumas tendências gerais da economia. Em meio às suas variações periódicas, conseguimos distinguir certos momentos que caracterizam o funcionamento da economia, onde se notam as expectativas dos investidores com relação ao comportamento esperado das ações (Neto, 2009). O objetivo desse trabalho é fazer uma análise do comportamento do Ibovespa pelo método de Box e Jenkins para prever oportunidades de compra e venda de ações, utilizando dados diários de janeiro de 2009 à janeiro de 2013 e em seguida comparar com os dados reais para verificar se o modelo encontrado obteve um bom comportamento perante a série. Usando a método de Box e Jenkins, o modelo ajustado foi ARIMA(1,1,0).

Palavras-chave: *Ibovespa, Box e Jenkins.*

Referências

- [1] IPEADATA. Índice de ações - Ibovespa - fechamento. Consultado em: 04/05/2013. Disponível em: <<http://www.ipeadata.gov.br>>
- [2] MORETTIN, P.A. *Econometria Financeira*. São Paulo: Universidade de São Paulo, 2006.
- [3] NETO, A.S. *Mercado Financeiro*. Editora Atlas. São Paulo, 2009.

¹UNIFAL - Universidade Federal de Alfenas. Email: altierezoliveira@yahoo.com.br

²UNIFAL - Universidade Federal de Alfenas. Email: gislene.pereira@unifal-mf.edu.br

³UNIFAL - Universidade Federal de Alfenas. Email: leticia.rodriques@unifal-mg.edu.br

⁴Agradecimento à FAPEMIG pelo apoio financeiro.