

A CONSTRUÇÃO DE UM MODELO DE PREDIÇÃO: uma aplicação na série de valores da Taxa Selic

Afonso de Paula Feliciano[*]
Lázaro Eduardo da Silva[**]

RESUMO

Este trabalho propõe a construção de um modelo de predição capaz de analisar a Taxa Selic com o intuito de identificar tendências de investimentos financeiros. Tal abordagem se justifica devido a importância da Taxa Selic e sua referência nacional em contextos bancários e empresariais. Este estudo quantitativo é considerado exploratório-descritivo e seu propósito é analisar a variação mensal dos valores da Taxa Selic e seu impacto nos Fundos de Investimentos Referenciados no Brasil. Este intento será explorado através da aplicação de modelagem computacional em uma Base de Dados pública localizada na Central de Custódia e Liquidação Financeira de Títulos – CETIP. A análise buscará demonstrar através de Gráficos de Equações a Diferenças as principais tendências financeiras fornecendo ao investidor uma rápida capacidade de decisão bem como ao pesquisador de modelagem matemática e computacional uma fácil replicação dos procedimentos realizados, podendo validar as interpretações aplicadas nesta pesquisa nos mais diversos segmentos socioeconômicos.

Palavras-chave: Modelagem computacional. Modelagem matemática. Taxa Selic. Investimento. Modelo de predição.

[*] Pós-Graduando em Modelagem Científica e Tecnológica pela Universidade de Federal de Alfenas – Campus Varginha. Graduado em Tecnologia de Análise e Desenvolvimento de Sistemas pelo Centro Universitário do Sul de Minas – UNIS/MG. E-mail: <afonsofeliciano@live.com>.
[**] Doutor em Ciências pelo Programa de Engenharia Elétrica da Escola de Engenharia de São Carlos - Universidade de São Paulo. E-mail: <lazaro@cefetmg.br>.