



E0496

MODELAGEM FUZZY PARA A TOMADA DE DECISÕES NO MERCADO FINANCEIRO

Bruno Luís Honigmann Cereser (Bolsista PIBIC/CNPq) e Prof. Dr. Laércio Luis Vendite (Orientador), Instituto de Matemática, Estatística e Computação Científica - IMECC, UNICAMP

Nesse trabalho procuramos inicialmente reproduzir o que foi feito em "Lógica fuzzy para tomada de decisão em negócios e finanças", onde com a in ação e o dólar foi possível, através da lógica fuzzy, aproximar a taxa SELIC. Para isso, foram coletados dados sobre a inflação, dólar e SELIC do período de Janeiro de 2006 até Fevereiro de 2009 A busca foi feita no IPEA e no Banco do Brasil. Os dados foram analisados, e foi criada uma base de regras fuzzy, e com o auxílio do software MatLab, foi possível fazer uma previsão da Taxa SELIC mensal, tendo em vista a taxa de juros e a taxa do dolar no mês. Dessa maneira, é possível fazer uma aproximação da Taxa Selic do período desejado, conhecendo-se a taxa de juros e a taxa do dólar.

Teoria fuzzy - Mercado financeiro - Modelagem matemática