Aplicação do método multicritério FITradeoff para elaboração de modelo para pré-seleção de ativos

Jadson Ferreira Jacob[1]
jadsonfjacob@gmail.com
Alexandre Guilherme Rodrigues Varella[1]
varellalexandre@gmail.com
Wilkson Ricardo Silva Castro[1]
wilkson.rsc@gmail.com
Ricardo Pires de Souza[2]
ripiso@gmail.com
Éverton Santi[3]
santi.everton@gmail.com

[1]Mestrando em Engenharia de Produção na UFRN
[2]Professor Adjunto no Programa de Pós-Graduação em Engenharia de Produção na UFRN
[3]Professor Auxiliar no Programa de Pós-Graduação em Engenharia de Produção na UFRN

RESUMO

O investidor e operador de mercado financeiro possui inúmeras alternativas a serem analisadas antes de escolher em quais ativos investir. Dentre as ações negociadas na bolsa de valores de São Paulo o gestor necessita pré-selecionar alguns ativos, os quais ainda deverão ser estudados pelo analista para que sejam potenciais componentes de uma carteira. O objetivo deste estudo é propor o método FITradeoff como ferramenta para pré-seleção de ativos da bolsa de valores brasileira. Consequentemente, um modelo de decisão de múltiplos critérios baseado no FITradeoff é desenvolvido para identificar e ordenar as opções. 27 papéis foram avaliados segundo 8 critérios de avaliação. As ações analisadas são listadas na B3, cujos dados foram coletados no site da Economática, que os disponibilizou em planilha eletrônica. Com base nos resultados alcançados, conclui-se que, com o auxílio do FITradeoff, é possível pré-selecionar ativos pelo modelo de ranqueamento desenvolvido.

PALAVRAS-CHAVE: FITradeoff, mercado de capitais, ações.
Tópicos: Decisão multicritério e Ações

ABSTRACT

The investor and financial market operator has numerous alternatives to be analyzed before choosing which assets to invest. Among the shares traded on the São Paulo stock exchange, the manager needs to pre-select some assets, which must still be studied by the analyst in order to be potential components of a portfolio. The objective of this study is to propose the FITradeoff method as a tool for pre-selection of assets on the Brazilian stock exchange. Consequently, a multi-criteria decision model based on FITradeoff is developed to identify and order the options. 27 stocks exchanges were evaluated according to 8 evaluation criteria. The analyzed shares are listed in B3, whose data were collected on the Economática website, which made them available in an electronic spreadsheet. Based on the results achieved, it is concluded that, with the help of FITradeoff, it is possible to pre-select assets by the ranking model developed.

PALAVRAS-CHAVE: FITradeoff, capital market, shares.
Paper topics: Multicriteria Decision and Shares

Galoá { Este trabalho foi publicado utilizando o **Galoá** proceedings