



WAIAF 2019

Workshop of Artificial Intelligence Applied to Finance

Bem-vindos!

ITA, São José dos Campos/SP, 15 e 16 de Maio de 2019

<http://www.comp.ita.br/labsca/waiaf/>

Patrocínio

Gold:

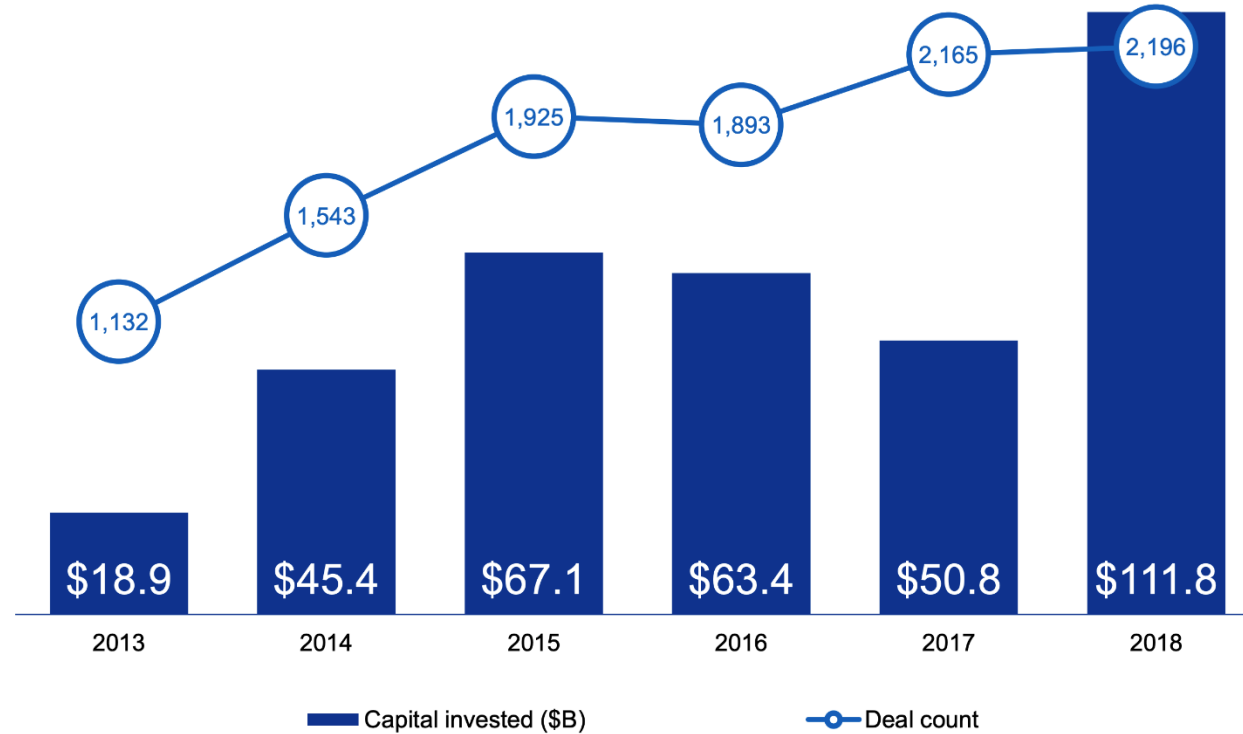


Silver:



Panorama - IA aplicada a Finanças...

Total investment activity (VC, PE and M&A) in fintech
2013–2018



Source: Pulse of Fintech 2018, Global Analysis of Investment in Fintech, KPMG International (data provided by PitchBook) January 4, 2019.

Panorama - IA aplicada a Finanças - 2

- Advisors, Analysts and management Robots are engaging...

Robo-advice is on the rise but it needs a lot of work before people trust it



ANDREW REESON, ANDREAS DUENSER, CSIRO
AUG 4, 2017, 9:28 AM

EquBot Announces the Launch of the AI Powered International Equity ETF (AIQ)

Firm expands its AI-focused ETF offerings with new fund that targets opportunities in developed international markets outside the U.S.

June 06, 2018

- No Brasil, também ...

XP investe na Olivia, startup que ajuda usuário a economizar

Fundada por dois brasileiros no Vale do Silício, Olivia usa inteligência artificial para dar dicas de comportamento; sistema agora orientará para investimentos da corretora

05/02/2019



Panorama - IA aplicada a Finanças - 3

- Um aviso:
- “..many investors fail to grasp the complexity of ML applications to investments.....their high expectations will not be met, not because ML failed, but because they used ML incorrectly. Over the coming years, many firms will invest with off-the-shelf ML algorithms, directly imported from academia or Silicon Valley, and my forecast is that they will lose money (to better ML solutions). Beating the wisdom of the crowds is harder than recognizing faces or driving cars.”
- E uma previsão..
- “...One day in the near future, ML will dominate finance, science will curtail guessing, and investing will not mean gambling...”

Marco L. de Prado

Author of the 2018 book **Advances in Financial Machine Learning, Wiley**

Cornell University Professor and Professional Investment manager with several multibillion-dollar funds for institutional investors using machine learning algorithms

WAIAF 2019

- 196 Registrations
 - Students, Researchers and Professionals
- Accepted Papers
 - Autonomous Fundamentalist Analysis (2)
 - Autonomous Technical Analysis
 - Deep Learning (2)
 - Machine Learning (3)
 - Reinforcement Learning
 - Sentiment Analysis
 - Smart Contracts
 - Trading systems
 - Web Scrapping

WAIAF 2019 – Keynote Speakers

- Olivia: a assistente financeira baseada em IA,
 - Filipe Polizel e Ricardo Herrmann (Olivia)
- Economia Digital : Trust- Confiança; Value- Valor; Ownership- Propriedade
 - Prof. Dr. Nizam Omar (Universidade Presbiteriana Mackenzie)
- Sistematização de alarmes *Wavelets* para flash crash.
 - Prof. Dr. Marco Antonio L. Caetano (INSPER):

Programação WAIAF 2019

15 de Maio de 2019, Quarta-feira

Início	Término	Título	Duração
9:30	10:00	A Inteligência Artificial na Olívia	0:30
10:00	10:10	P&R	0:10
10:10	10:30	Felipe Paiva: Métodos de Deep Learning Aplicados a Candlestick como Estratégia de Investimento	0:20
10:30	10:40	P&R	0:10
10:40	11:05	Coffe-Break	0:25
11:05	11:25	Mateus Saldanha: Identificação em tempo real de Manipulação no Mercado Financeiro de Ações e Derivativos por Spoofing e Layering	0:20
11:25	11:35	P&R	0:10
11:35	11:55	Edson Bastos: Aplicação do Support Vector Machine (SVM) em conjunto com variáveis de análise técnica.	0:20
11:55	12:05	P&R	0:10
12:05	13:45	Intervalo do Almoço	1:40
13:45	14:15	Palestrante Convidado – Prof. Dr. Nizam Omar (Universidade Mackenzie) - Economia Digital : Trust- Confiança; Value- Valor; Ownership-Propriedade	0:30
14:15	14:25	P&R	0:10
14:25	14:45	Caio Mesquita: Utilização de uma rede neural LSTM e testes da razão da variância para previsões em séries de ativos da Bovespa	0:20
14:45	14:55	P&R	0:10
14:55	15:15	Renato de Oliveira: Agente de Negociação de Ações Utilizando Aprendizado Por Reforço	0:20
15:15	15:25	P&R	0:10
15:25	15:50	Coffe-Break	0:25
15:50	16:10	Michel Leles: Trading System based on a MultCriteria Tool known as TODIM	0:20
16:10	16:20	P&R	0:10
16:20	16:40	Stéfano Spíndola. Usando aprendizado de máquina para prever sinal do movimento de ativos com auxílio de notícia	0:20
16:40	16:50	P&R	0:10
16:50	17:10	Vitor Peres: Análises de Sentimentos: abordagem lexical de classificação de opinião no contexto mercado financeiro brasileiro	0:20
17:10	17:20	P&R	0:10

16 de Maio de 2019, Quinta-feira

8:30	9:00	Recepção e Abertura	0:30
9:00	9:30	Palestrante Convidado – Prof. Dr. Marco Antonio L. Caetano (INSPER): Sistematização de alarmes wavelets para flash crash	0:30
9:30	9:35	P&R	0:05
9:35	9:55	Elton Sbruzzi. Análise multicritério de indicadores fundamentalista dos componentes do Ibovespa	0:20
9:55	10:00	P&R	0:05
10:00	10:20	Flávio Abdenur: Machine learning applied to accounting variables yields the risk-return metrics of private company portfolios	0:20
10:20	10:25	P&R	0:05
10:25	10:50	Coffe-Break	0:25
10:50	11:10	Gabriel de Melo: Gated Recurrent Unit Hierarchical Architecture for Fundamental Stock Analysis and Forecast	0:20
11:10	11:15	P&R	0:05
11:15	11:35	Dhaniel Mazini: Extração de dados financeiros com um web scraper: um estudo sobre a rentabilidade dos dividendos	0:20
11:35	11:40	P&R	0:05
11:40	12:00	Rafael Shigemura: Wibx: Making Smart Contracts Even Smarter	0:20
12:00	12:10	P&R	0:10
12:10	12:20	Encerramento do Workshop	0:10