PROJETO DE PESQUISA: Novas métricas para previsão de falências	
Líder:	Prof. Dr. Leonardo Fernando Cruz Basso
Inicio:	01/01/2017
Situação:	Em andamento
Financiamento:	
Natureza:	Pesquisa

DESCRIÇÃO: Uma das atividades fundamentais de empresas financeiras é gerenciar o risco. Em particular, o risco de crédito é um dos mais relevantes. Existem algumas formas de se estimá-lo e o acompanhamento do desempenho financeiro das empresas tem se mostrado uma ferramenta útil. Dentro desta perspectiva, a busca por variáveis explicativas é um trabalho em constante desenvolvimento, sendo que as medidas financeiras, ainda que muito comuns, carecem de maior poder explicativo e validade estatística. A modelagem do desempenho é um processo de grande dedicação de pesquisadores da área, mas os resultados são pouco abrangentes. Este projeto propõe o uso de métodos computacionais recentes, conhecidos por Machine Learnings, que vêm ganhando força desde a sua criação. O grupo de variáveis a serem estudadas é também outro ponto forte, uma vez que serão testadas novas métricas baseadas na taxa de variação de indicadores financeiros. As medidas de validação apresentam-se como um desafio final, pois existem poucas medidas empregadas atualmente.

Integrantes	**Categoria**
Eli Hadad Junior	Participante Externo
Flavio Luiz de Moraes Barboza	Participante Externo
Leonardo Fernando Cruz Basso	Docente – Líder
Luis Fernando Correa da Costa	Participante Externo