



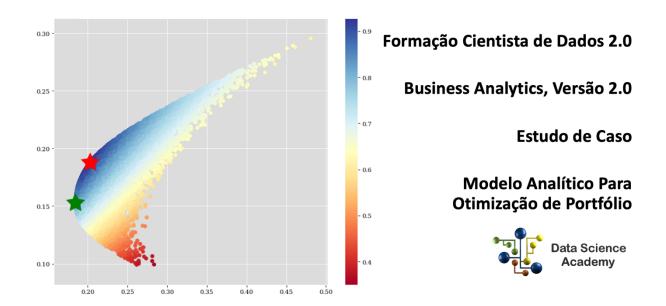
www.datascienceacademy.com.br

**Business Analytics** 

Estudo de Caso

Modelo Analítico Para Otimização de Portfólio





Ao final do capítulo, no item "Scripts e Datasets do Capítulo", você encontra os scripts do Estudo de Caso comentados linha a linha. Este estudo de caso é para auto estudo e para ser usado como material de referência. Leia os comentários, execute a app e faça pesquisa adicional se considerar necessário.

O estudo de caso é uma aplicação do RStudio Shiny para otimização de portfólios com base em um modelo de média-variância simples e um modelo Black-Litterman (módulo não concluído). O aplicativo exibe porcentagens a serem alocadas para cada classe de ativos (assets).

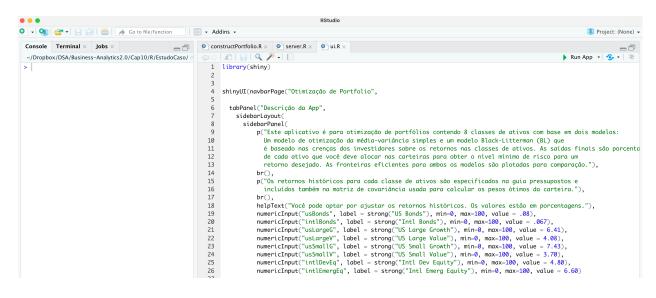
O Modelo Black-Litterman combina a opinião dos investidores sobre classes de ativos no modelo de otimização de portfólio, sendo muito utilizado em Fundos Hedge, com carteiras de bilhões de dólares.

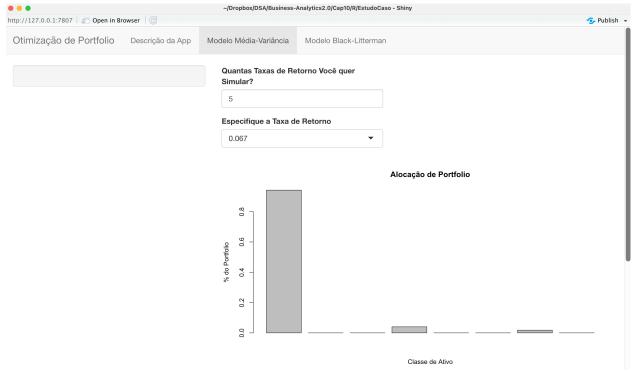
Esse aplicativo foi construído em módulos. Você pode expandi-lo e agregar mais módulos e outros tipos de análises. Para esse aplicativo, consideramos ativos americanos, por ser mais fácil encontrar documentação sobre tais ativos.

Para executar a app, carregue os 3 scripts no RStudio e execute Run App conforme as imagens abaixo.

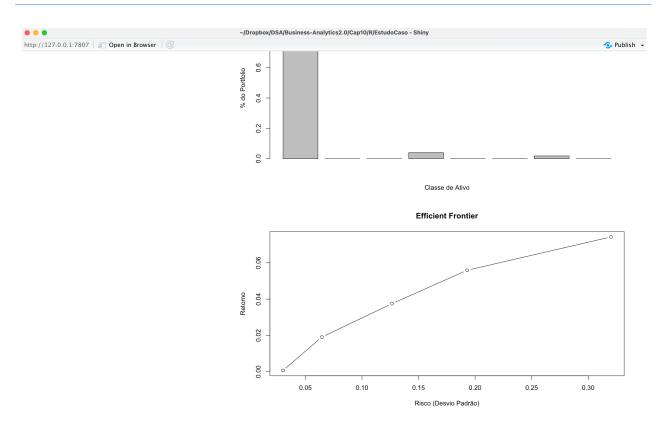


## **Business Analytics**





## **Business Analytics**



Bons estudos.