



Data Science Academy

[www.datascienceacademy.com.br](http://www.datascienceacademy.com.br)

Business Analytics

Mini-Projeto 2

Implementando um Modelo Analítico para  
Análise de Portfólio

## Especificação

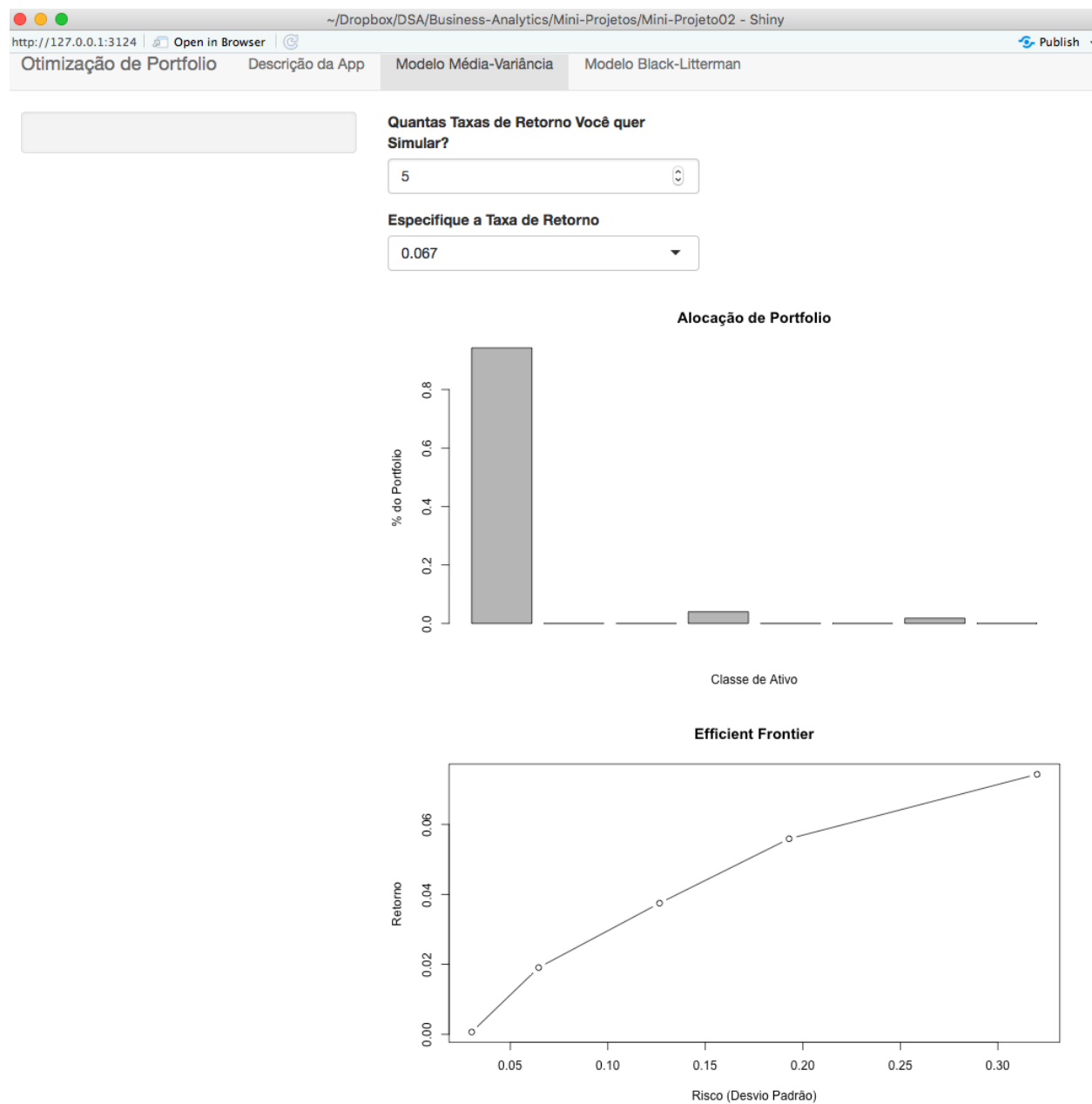
### Mini-Projeto - Otimização de Portfólio

Esse é aplicativo RStudio Shiny que constrói eficientes 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 uma clara compreensão do projeto, você deve passar por todos os itens de aprendizagem neste capítulo, incluindo o material sobre Otimização de Portfólio e CAPM. Os scripts estão comentados linha a linha.



Equipe DSA