

O PROBLEMA DA MOCHILA NA SELEÇÃO DE INVESTIMENTOS PARA UM FUNDO DE INVESTIMENTOS

Este estudo apresenta uma abordagem para aprimorar a alocação de recursos em fundos de investimentos utilizando o problema da mochila, por meio da aplicação de técnicas de otimização combinatória. Ao enfrentar o desafio de maximizar o retorno sobre os investimentos disponíveis, o estudo se concentra em um contexto específico: um fundo com um capital determinado para investir em várias opções de investimento. Considerando não apenas o montante inicial de cada opção, mas também seu Valor Presente Líquido (VPL), expresso em milhões de reais, o objetivo é determinar a combinação ótima de investimentos que resulte no maior VPL total, respeitando as restrições de capacidade do fundo. Através da aplicação rigorosa de métodos de otimização combinatória, o estudo revela insights valiosos sobre como alocar eficientemente os recursos do fundo, proporcionando uma base sólida para a tomada de decisões informadas na gestão de portfólios de investimentos. Ao destacar a eficácia dessa abordagem, o estudo contribui significativamente para a compreensão e prática da gestão de fundos de investimentos, evidenciando a importância de estratégias de otimização na maximização do retorno financeiro.

Palavras-chave: fundo de investimentos; problema da mochila; otimização combinatória; alocação de recursos.