

# Maximizando o Desempenho de Portfólio Através do Índice Sharpe

Grupo 8 - Gustavo Barroso Souza Cruz, Ian Cordibello Desponds

September 24, 2023

## Introdução ao Portfólio

O portfólio é estruturado de maneira fundamentada e coerente, justamente devido à sua adesão a princípios robustos e bem estabelecidos de gestão de ativos. Alicerçado na diversificação eficiente, desempenho histórico consistente, um índice Sharpe substancial, a meticulosa seleção de ativos e uma sólida compreensão do contexto econômico, esse portfólio se destaca como uma estratégia de investimento inteligente e fundamentada.

## Diversificação

Primeiramente, a diversificação desempenha um papel crucial na construção desse portfólio. A inclusão de ativos de diferentes setores, como telecomunicações, mineração, varejo farmacêutico, medicina diagnóstica e automação industrial, é uma medida prudente para mitigar riscos. Isso significa que o portfólio não está excessivamente concentrado em um único setor da economia, o que reduz significativamente a exposição a flutuações abruptas de preços em um segmento específico.

## Desempenho Histórico

Além disso, o desempenho histórico notável do portfólio ao longo dos últimos cinco anos é indicativo de que as escolhas de ativos foram acertadas. Embora seja essencial lembrar que o desempenho passado não é uma garantia de resultados futuros, a consistência ao longo do tempo sugere que a estratégia de investimento aplicada até o momento tem sido bem-sucedida.

## Índice Sharpe

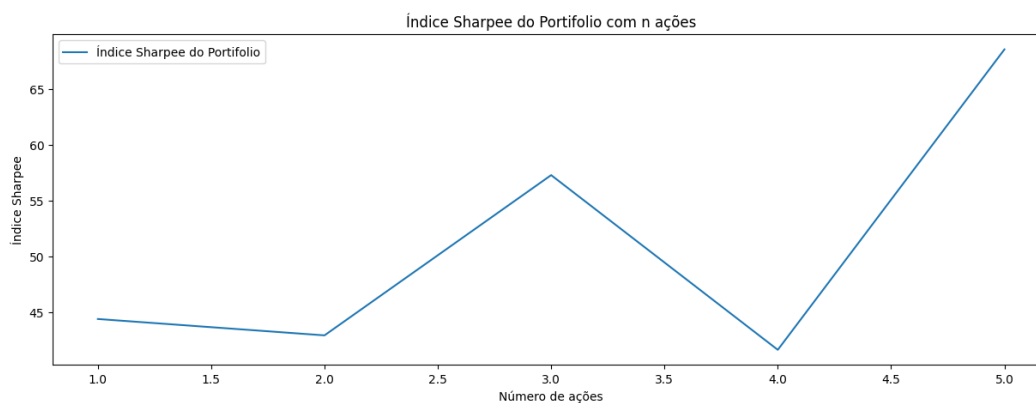
O índice Sharpe elevado, atingindo a notável marca de 68,58, é uma prova concreta de que o portfólio está gerando retornos superiores em relação ao risco assumido. Essa métrica é fundamental para avaliar a eficácia da alocação de ativos e demonstra que o portfólio está oferecendo uma recompensa substancial pelo risco incorporado.

## Seleção de Ativos

A seleção criteriosa de ativos também é um componente essencial desse portfólio. As empresas escolhidas, como a Telefônica, Vale, Raia Drogasil, Fleury e Weg, são líderes em seus respectivos setores e possuem históricos de desempenho sólidos. Esse rigor na seleção aumenta a confiança na capacidade dessas empresas de continuar a prosperar no ambiente de mercado.

# Conclusão

## 0.1 Gráfico



Em síntese, o portfólio em questão é uma escolha coesa e bem embasada, cuja estrutura é sustentada pela aplicação de princípios sólidos, como diversificação eficiente, desempenho histórico consistente, índice Sharpe elevado e uma seleção criteriosa de ativos. Esses elementos, juntos, contribuem para a robustez e a eficácia da estratégia de investimento adotada, refletindo uma abordagem informada e fundamentada no mundo dos investimentos.

## 0.2 Autoavaliação

Texto - Conceito A, porque nossa escolha de ações foi bem pensada, garantindo uma diversificação do portfólio, além de serem ativos já estabelecidos no mercado, o que evita grande volatilidade nos valores e proporciona um alto índice de sharpe e baixo risco. Gráfico - Conceito A, porque a figura representou a evolução do índice sharpe do portfólio à medida que ações são adicionadas, mostrando que o portfólio se torna mais eficiente e com menor risco.