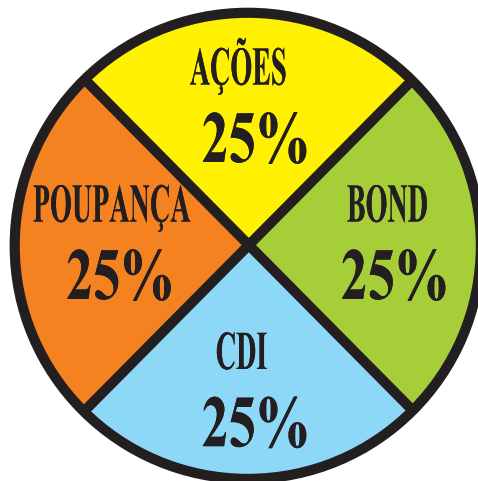
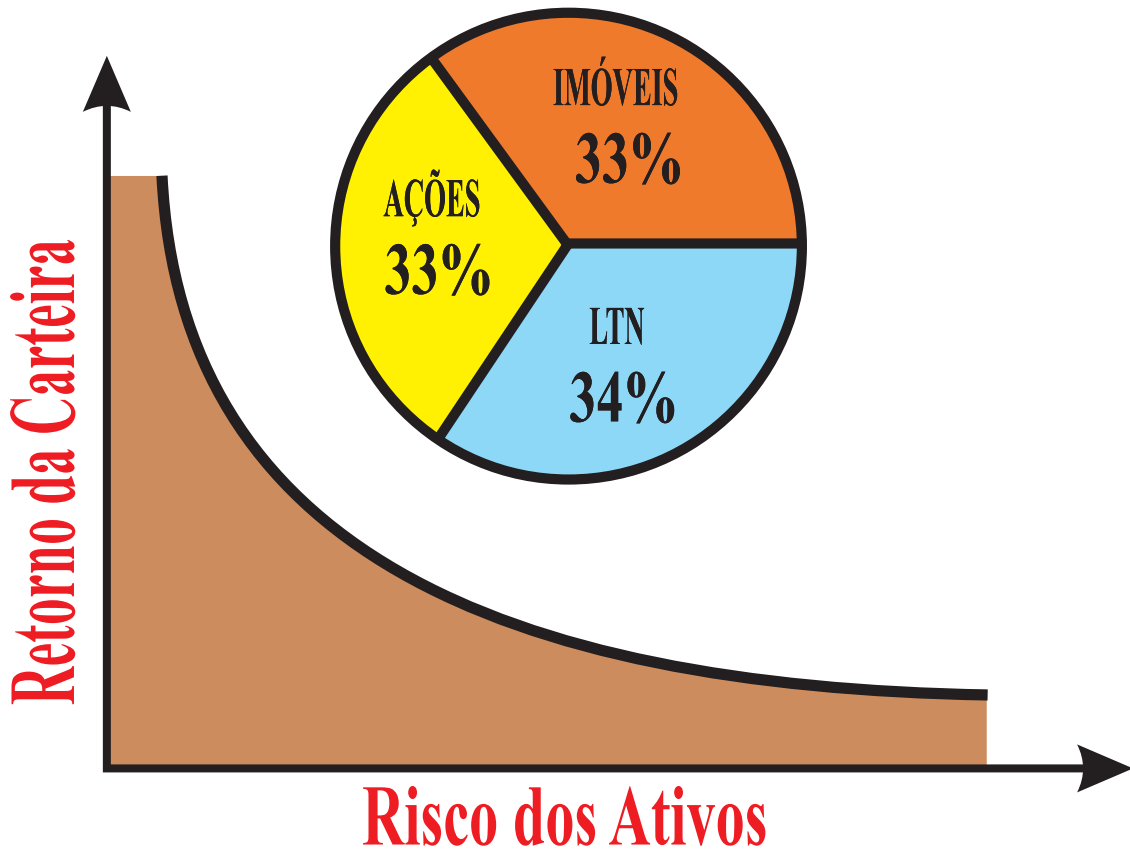




σ MONETA σ

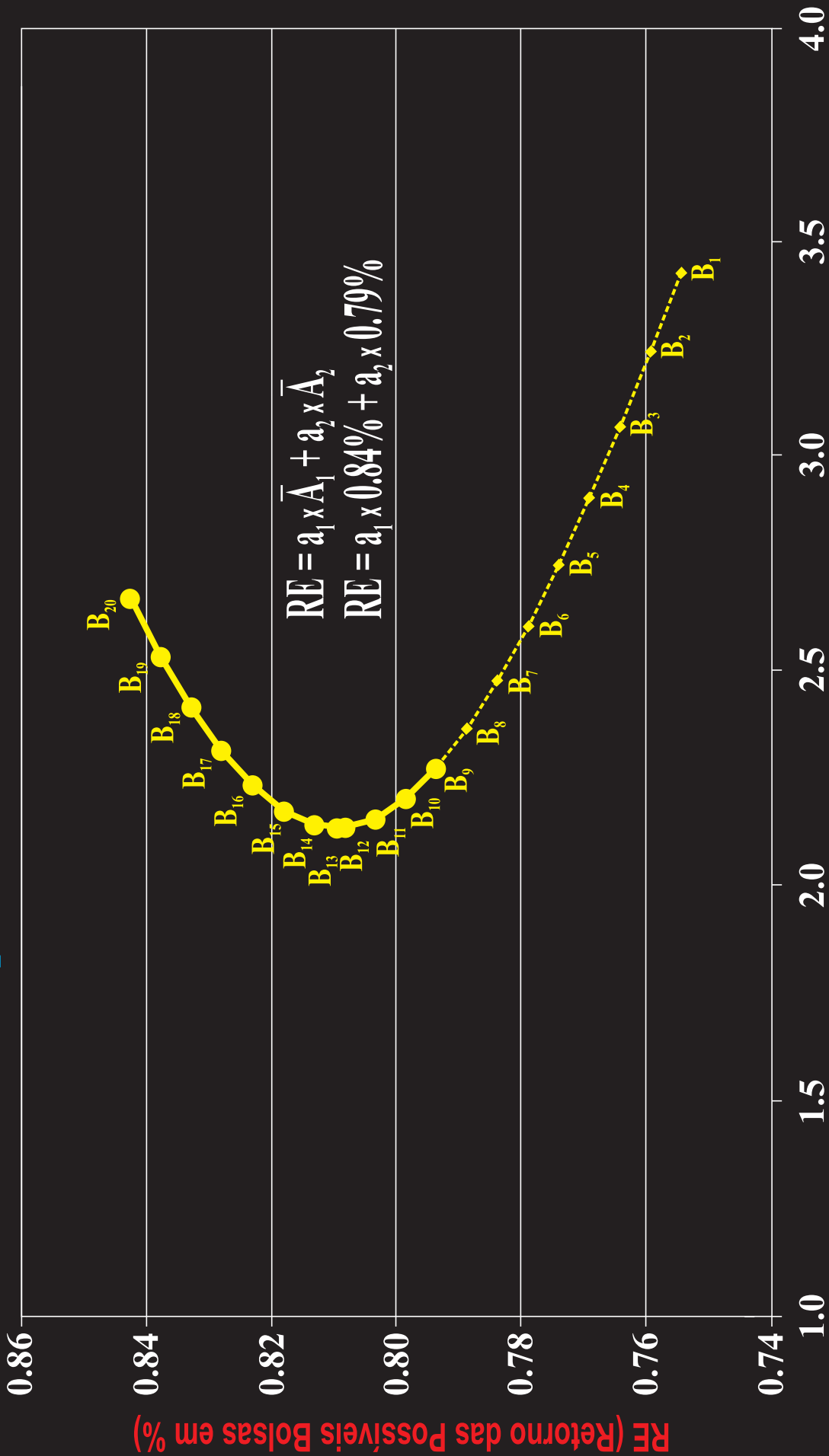


SELEÇÃO DE ATIVOS

Prof. Aguinaldo Prandini Ricieri



Gráfico Hiperbólico Retorno Otimizado de Markowitz





Programa MONETA em Linguagem Fortran

Uso Exclusivo no
Computador do Aluno Prandiano

```

PROGRAM MONETA
!   PROGRAMA FORTRAN90 PARA A IMPLEMENTAÇÃO DA TEORIA DE
MARKOWITZ
!
!               CURSO PRANDIANO
!   LIBERDADE DE USO SOMENTE NO COMPUTADOR DO ALUNO
!   OTIMIZAÇÃO DE FUNÇÃO MULTI-OBJETIVO
parameter (npmax=8) !número máximo de papéis a selecionar
implicit real (a-h,o-z)
allocatable :: xi(:, :)
integer d, selPap(100), iDpap(100)
real PerPap(100,100), CotPap(100,101), Med(100)
real Cov(100,100), E(100), X(100)
common/parametros/Retorno, Cov, E, Q, Sigp, npsele, rp

!Arquivos utilizados:
open(6, file='SaidaMoneta.txt')
open(10, file='DadosMoneta.txt')

!Leitura do número de papéis, períodos, cotações:
read(10, *) npapeis, nper
read(10, *) ((CotPap(j, i)), j=1, npapeis), i=1, nper+1) !papel em
linha

!Cálculo das percentagens de crescimento:
do i=1, npapeis
sum=0.
do j=1, nper
PerPap(i, j) = (CotPap(i, j+1) - CotPap(i, j)) / CotPap(i, j) * 100.
sum=sum+PerPap(i, j)
enddo
Med(i) = sum/nper !media das percentagens de crescimento
enddo

!Seleção pela média:
call SelectPapsporMed(npapeis, npsele, npmax, Med, selPap, E)
allocate (xi(npsele, npsele), stat=ierror)

!Cria matriz de covariancia dos papéis selecionados:
ir=0
do i=1, npapeis
if(selPap(i).eq.1) cycle
ir=ir+1
jc=0
do j=1, npapeis
if(selPap(j).eq.1) cycle
jc=jc+1
Cov(ir, jc) = 0.0d0
do d=1, nper
Cov(ir, jc) = Cov(ir, jc) + (PerPap(i, d) - med(i)) * (PerPap(j, d) -
med(j))
enddo
Cov(ir, jc) = Cov(ir, jc) / nper
enddo
enddo

```

