



Bem-vindo

Fazer login no QuantBox e continuar para
QuantBox Dashboard.

Endereço de e-mail

luiz.ohara@quantbox.com.br

Senha

••••••••



[Esqueceu a senha?](#)

Continuar

Tela de Login:
www.dashboard.quantbox.com.br

Instâncias

 Ohara Custom Produção Dados completos e envio de ordens para o ambiente produtivo da B3. Acessar Instância	 Production Acesso completo aos dados e envio de ordens em ambiente de produção da B3. Acessar Instância	 Educacional Acesso completo aos dados. Envio de ordens em ambiente de homologação da B3. Acessar Instância	 Beta Acesso ao sample de dados e envio de ordens em ambiente de homologação da B3. Acessar Instância
--	---	--	--

Tela Seleção Instâncias

← → ↻ https://dashboard.quantbox.com.br/instancia

Semantix **QUANTBOX** Instâncias Ordens Perguntas Frequentes Olá, Luiz Ohara

File Edit View Run Kernel Hub Tabs Settings Help

Files

Name	Last Modified
lost+found	3 months ago
portfolio_optimization.i...	a day ago
teste_GetHistoricalData...	3 days ago
teste_GetRealTimeData...	3 days ago
teste_QuantBox.ipynb	3 days ago
teste_TechIndicators.ip...	3 days ago
Welcome.ipynb	3 months ago

Running

Commands

Cell Tools

Tabs

portfolio_optimization.ipynk × teste_GetRealTimeData.ipynk × teste_GetHistoricalData.ipynk × teste_QuantBox.ipynb ×

Markdown Python 3

Modern Portfolio Theory

Modern Portfolio Theory (MPT) também conhecido como modelo de média-variância. Modelo matemático com embasamento no teoria de finanças dos vencedores do prêmio Nobel em Economia Harry Markowitz (1952) e Willian Sharpe (1964).

Conforme postulado, o consumidor é averso ao risco, ou seja, entre dois portfólios de mesmo retorno esperado, o consumidor sempre vai preferir o portfólio de menor risco. E de forma dual, entre dois portfólios de mesmo risco, o consumidor sempre vai preferir o de maior retorno.

No modelo, definimos o retorno esperado do portfólio como uma combinação linear das ponderações (w) com os retornos esperados (R) dos ativos disponíveis:

E o risco, medido pela variância do portfólio conforme modelo de Gaussiano:

$$w^T \Sigma w$$

Conforme postulado, existirá então um conjunto alocações de ativos considerados ótimos denominado fronteira eficiente. O problema do indivíduo é realizar a melhor combinação deste conjunto de alocações de forma a maximizar a razão risco e retorno. Para um cenário ausente de um instrumento de captação e livre de risco. Temos a solução algébrica definido por:

$$\begin{bmatrix} 2\Sigma & -R \\ R^T & 0 \end{bmatrix} * \begin{bmatrix} w \\ \lambda \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ \mu \end{bmatrix}$$

Na presença de um ativo livre de risco que também é instrumento de captação para compor as estratégias. O problema do indivíduo passa a ser a escolha entre alocar parte dos seus recursos neste ativo livre de risco e alocar em uma combinação de ativos com risco. Regularmente conhecido como o modelo de dois fundos mútuos.

Os serviços da Semantix não representam um relatório de análise de valores mobiliários para os fins da ICVM 598, de tal forma que compete ao usuário tomar a sua decisão de investimento com base em convicção própria ou mediante o assessoramento de profissional habilitado.

Instância Production

← → ↻ https://dashboard.quantbox.com.br/instancia

Semantix
QUANTBOX

Instâncias Ordens Perguntas Frequentes Olá, Luiz Ohara

File Edit View Run Kernel Hub Tabs Settings Help

Files

Name	Last Modified
lost+found	3 months ago
portfolio_optimization.i...	a day ago
teste_GetHistoricalData...	3 days ago
teste_GetRealTimeData...	3 days ago
teste_QuantBox.ipynb	3 days ago
teste_TechIndicators.ip...	3 days ago
Welcome.ipynb	3 months ago

Running

Commands

Cell Tools

Tabs

portfolio_optimization.ipynk × teste_GetRealTimeData.ipynk × teste_GetHistoricalData.ipynk × teste_QuantBox.ipynb ×

Python 3

Modern Portfolio Theory

Modern Portfolio Theory (MPT) também conhecido como modelo de média-variância. Modelo matemático com embasamento no teoria de finanças dos vencedores do prêmio Nobel em Economia Harry Markowitz (1952) e Willian Sharpe (1964).

Conforme postulado, o consumidor é averso ao risco, ou seja, entre dois portfólios de mesmo retorno esperado, o consumidor sempre vai preferir o portfólio de menor risco. E de forma dual, entre dois portfólios de mesmo risco, o consumidor sempre vai preferir o de maior retorno.

No modelo, definimos o retorno esperado do portfólio como uma combinação linear das ponderações (w) com os retornos esperados (R) dos ativos disponíveis:

E o risco, medido pela variância do portfólio conforme modelo de Gaussiano:

$$w^T \Sigma w$$

Conforme postulado, existirá então um conjunto alocações de ativos considerados ótimos denominado fronteira eficiente. O problema do indivíduo é realizar a melhor combinação deste conjunto de alocações de forma a maximizar a razão risco e retorno. Para um cenário ausente de um instrumento de captação e livre de risco. Temos a solução algébrica definido por:

$$\begin{bmatrix} 2\Sigma & -R \\ R^T & 0 \end{bmatrix} * \begin{bmatrix} w \\ \lambda \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ \mu \end{bmatrix}$$

Na presença de um ativo livre de risco que também é instrumento de captação para compor as estratégias. O problema do indivíduo passa a ser a escolha entre alocar parte dos seus recursos neste ativo livre de risco e alocar em uma combinação de ativos com risco. Regularmente conhecido como o modelo de dois fundos mútuos.

Os serviços da Semantix não representam um relatório de análise de valores mobiliários para os fins da ICVM 598, de tal forma que compete ao usuário tomar a sua decisão de investimento com base em convicção própria ou mediante o assessoramento de profissional habilitado.

Instância Production

← → ↻ 🔒 https://dashboard.quantbox.com.br/ordens 🔍 ⭐ ⚙️ 👤 ...

QUANTBOX Instâncias Ordens Perguntas Frequentes Olá, Luiz Ohara 👤

Nova Ordem

Side: BUY | Símbolo: Ex: PETR4

Quantidade: | Preço: | Apply

Time in Force: DAY | Tipo de Ordem: LIMIT

Conta: Produção (35002) | Enviar?: Enviar

ID da Estratégia: | Enviar

Período: 01/03/2021 → 18/03/2021

Recarregamento Desativado Cancelar Ordens

Id	Strategy	Symbol	Status	Send Status	Price	Account	Send Time	Last Status	Actions
----	----------	--------	--------	-------------	-------	---------	-----------	-------------	---------

Os serviços da Semantix não representam um relatório de análise de valores mobiliários para os fins da ICVM 598, de tal forma que compete ao usuário tomar a sua decisão de investimento com base em convicção própria ou mediante o assessoramento de profissional habilitado.

Boletador e dash
envio da ordem