

## Jogo de Simulação de Gestão de Carteiras

MIF 2010/2011

As classificações obtidas no jogo de simulação foram: 20, 18, 16, 14, 12, 10 e 8. Nenhum grupo foi desclassificado por falta de cumprimento das regras. Optei por atribuir a dois grupos a classificação de 16 (por terem índices de sharpe muito próximos) e por incluir as notas 14 e 10, para uma melhor discriminação das notas. Obtiveram a classificação de 14 os grupos com índices de sharpe maiores ou iguais a 3. Obtiveram a classificação de 10 os grupos com índice de sharpe menor do que o meu, mas com valores muito próximos.

Julgo que as figuras e tabelas falam por si. Em caso de dúvida agradeço que me contactem por e-mail ou se dirijam aos horários de atendimento.

A Docente,

Raquel M. Gaspar

Tabela 1 -Ranking por Índice de Sharpe de 17/12/2010		
	Sharpe Ratio	NOTA JOGO
AGJLL	5.05	20
Limaobrothers	4.54	18
Se7en	4.16	16
Mifs	4.06	16
DAFD	3.60	14
ripainvestments	3.43	14
YoungBrokers	3.07	14
Grupo8	3.00	14
winner1	2.6	12
belmiroazevedo	2.55	12
MIF11	1.82	12
tekrams	1.41	12
<b>PROF</b>	<b>1.24</b>	---
mifiseg2010	1.2	10
SLAS	1.15	10
DJMP	0.48	8
Ratatui	0.25	8
lateplayers	0.17	8

Figura 1 – Gráfico teoria Média-Variância  
 Valores anualizados de rentabilidade esperada e volatilidade a 17/12/2010.

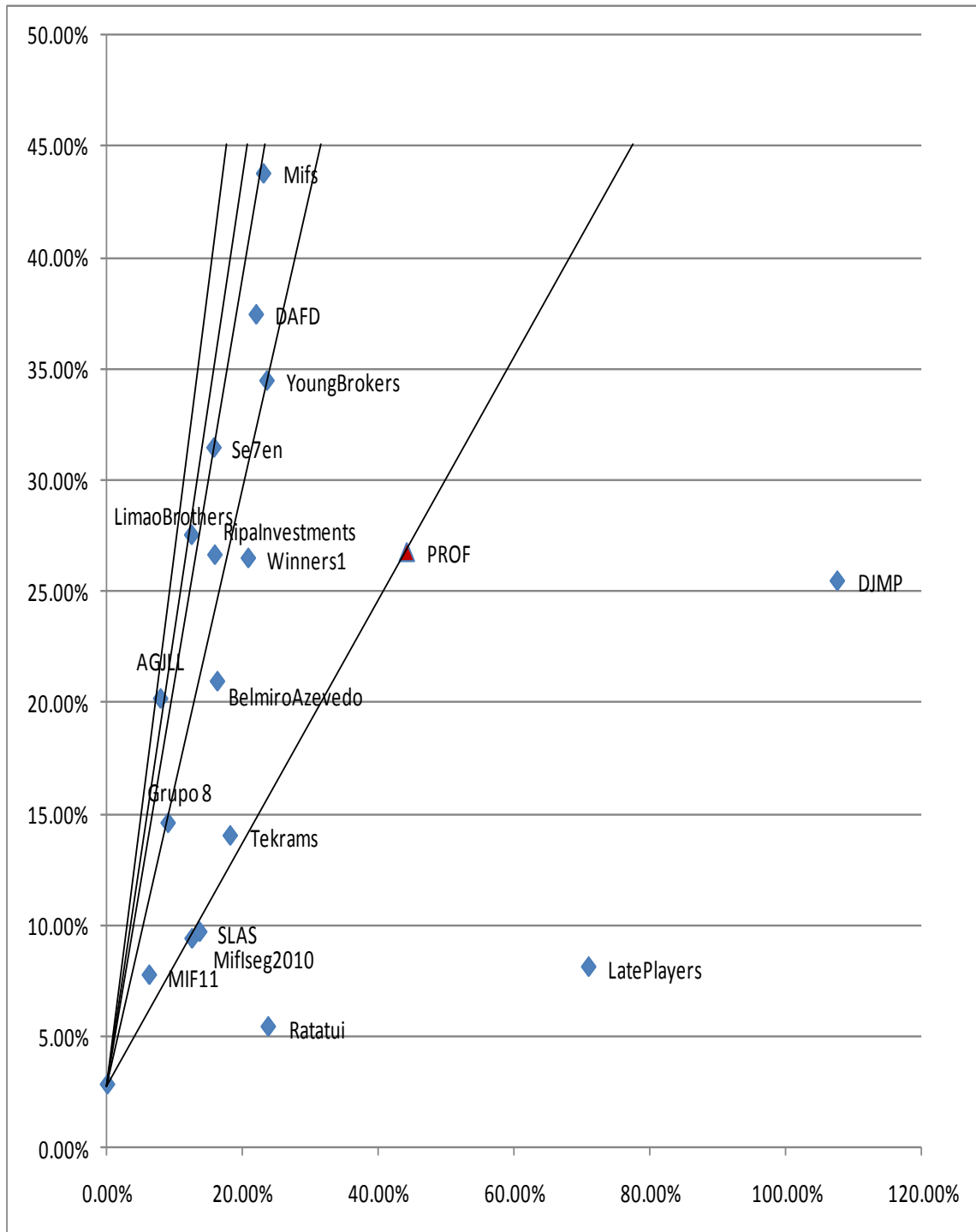


Tabela 2 - Evolução dos Índices de Sharpe  
(Grupos por ordem alfabética)

	22-Oct-10	29-Oct-10	5-Nov-10	12-Nov-10	19-Nov-10	26-Nov-10	3-Dec-10	10-Dec-10	17-Dec-10
AGJLL	1.47	-1.07	-1.45	3.68	2.34	3.64	4.67	5.3	5.05
belmiroazevedo	12.51	8.93	7.33	0.13	2.36	2.23	2.39	2.72	2.55
DAFD	5.34	7.62	4.63	0.30	2.14	3.60	4.10	4.08	3.60
DJMP	-7.28	-0.40	0.79	0.39	0.14	0.30	0.43	0.56	0.48
Grupo8	4.11	4.20	4.18	5.04	4.25	2.84	2.92	2.93	3.00
lateplayers			2.86	-0.02	-0.07	0.08	0.11	0.14	0.17
LimaoBrothers	3.65	3.51	1.98	4.73	2.91	3.72	3.58	4.59	4.54
MIF11	0.11	0.37	-1.11	-2.7	-0.28	2.19	1.49	1.75	1.82
mifiseg2010	-1.5	0.92	-1.21	-1.75	-1.66	-0.32	0.36	1.26	1.2
Mifs	-7.84	-5.05	0.49	7.12	1.56	4.49	4.42	4.63	4.06
Ratatui	-2.94	0.3	2.78	0.91	-1.5	-0.53	-0.05	0.17	0.25
ripainvestments	-0.44	0.96	1.46	6.15	2.48	3.64	3.59	3.63	3.43
Se7en	6.07	6.02	5.7	1.05	0.5	1.04	1.09	4.7	4.16
SLAS	3.52	-3.69	-4.82	1.61	0.01	1.42	-0.3	1.06	1.15
tekrams	2.65	3.47	2.53	2.57	0.77	1.62	1.39	1.42	1.41
winners1	-3.8	-0.59	-1.58	1.77	1.25	2.33	2.56	2.83	2.6
YoungBrokers	-1.14	0.44	0.47	4.09	0.89	2.73	3.15	3.43	3.07
<b>PROF</b>	<b>-1.50</b>	<b>-1.42</b>	<b>-1.51</b>	<b>-0.92</b>	<b>-0.56</b>	<b>-0.23</b>	<b>0.15</b>	<b>1.12</b>	<b>1.24</b>

Figura 2 -Evolução dos Índice de Sharpe

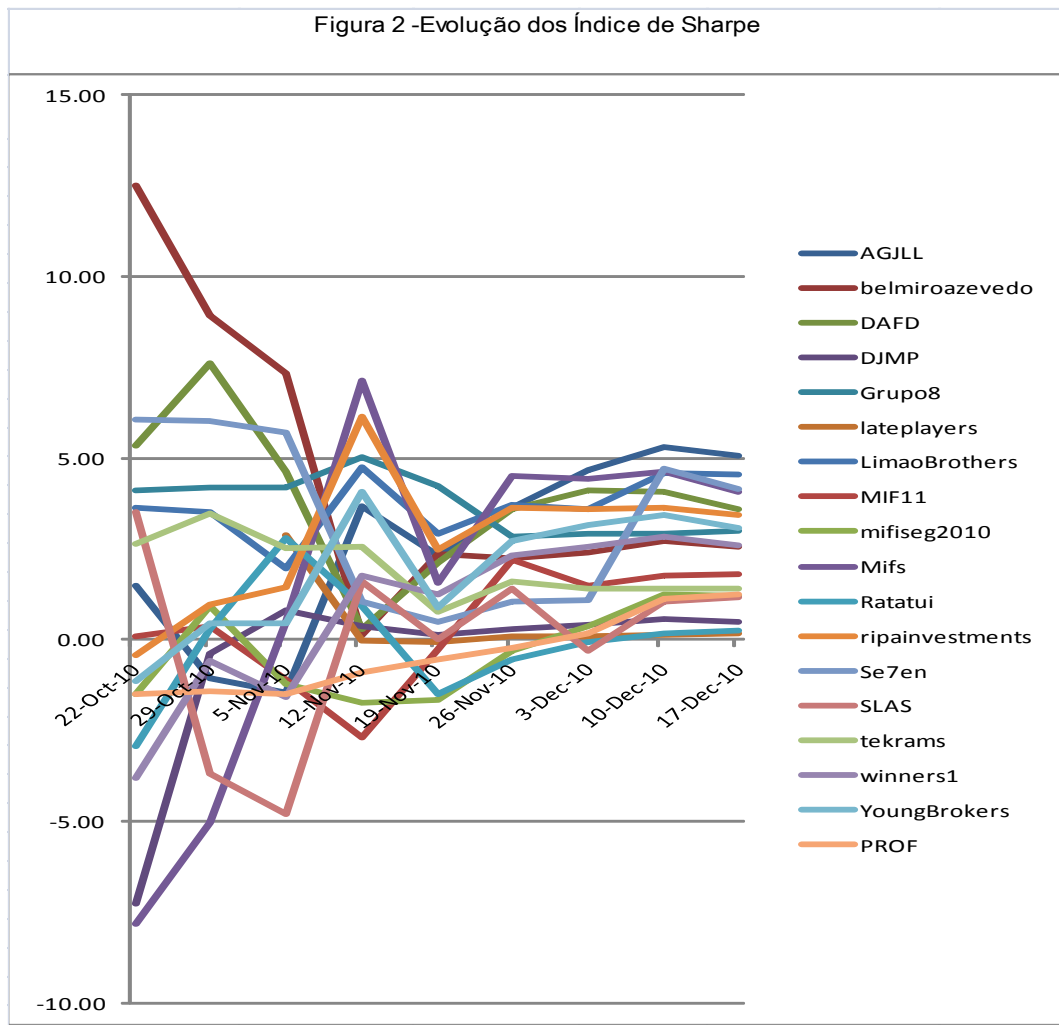


Tabela 3 - Evolução das Rendibilidades  
(Grupos por ordem alfabética)

	22-Oct-10	29-Oct-10	5-Nov-10	12-Nov-10	19-Nov-10	26-Nov-10	3-Dec-10	10-Dec-10	17-Dec-10
AGJLL	0.01%	0.14%	0.62%	0.96%	1.09%	1.90%	2.78%	3.49%	3.88%
belmiroazevedo	1.04%	1.90%	2.39%	2.16%	2.49%	2.74%	3.25%	3.99%	4.03%
DAFD	0.99%	2.04%	3.95%	3.15%	2.15%	4.97%	6.54%	7.22%	7.20%
DJMP	-1.72%	0.01%	0.94%	0.96%	1.02%	2.61%	3.85%	5.34%	4.90%
Grupo8	0.75%	1.25%	1.81%	1.90%	1.92%	1.79%	2.09%	2.44%	2.80%
lateplayers	n.a.	-0.01%	0.17%	-0.35%	-0.07%	0.65%	0.92%	1.27%	1.56%
LimaoBrothers	0.22%	1.26%	1.34%	1.72%	1.53%	2.81%	3.33%	4.64%	5.30%
MIF11	0.12%	0.15%	0.20%	-0.41%	0.27%	1.04%	1.01%	1.33%	1.49%
mifiseg2010	-0.13%	0.37%	-0.54%	-0.99%	-0.96%	0.13%	0.74%	1.70%	1.81%
Mifs	-0.06%	-0.24%	0.49%	1.80%	1.88%	6.92%	7.58%	8.66%	8.42%
Ratatau	0.19%	0.24%	2.07%	-0.82%	-2.20%	-0.46%	0.34%	0.82%	1.04%
ripainvestments	-0.12%	0.67%	1.61%	2.21%	1.82%	3.77%	4.36%	4.94%	5.12%
Se7en	0.68%	0.91%	2.11%	2.30%	1.85%	4.33%	4.95%	6.07%	6.05%
SLAS	0.11%	0.14%	0.12%	0.08%	0.38%	1.06%	0.15%	1.61%	1.86%
tekrams	0.78%	1.50%	2.39%	0.84%	0.61%	2.18%	2.15%	2.50%	2.70%
winners1	-0.66%	0.93%	0.05%	0.83%	1.54%	3.44%	4.24%	5.07%	5.10%
YoungBrokers	-0.29%	0.65%	1.15%	1.68%	1.04%	4.06%	5.48%	6.54%	6.63%
<b>RF</b>	<b>0.09%</b>	<b>0.15%</b>	<b>0.21%</b>	<b>0.26%</b>	<b>0.32%</b>	<b>0.38%</b>	<b>0.44%</b>	<b>0.49%</b>	<b>0.54%</b>
<b>PROF</b>	<b>-3.89%</b>	<b>-2.32%</b>	<b>-0.80%</b>	<b>-0.96%</b>	<b>-2.07%</b>	<b>-2.54%</b>	<b>0.07%</b>	<b>2.94%</b>	<b>5.15%</b>

Figura 3 -Evolução das Rendibilidades

