FICHA CATALOGRÁFICA

Dantas, Allan Leão
Otimização multiperíodo por média-variância sem posições a descoberto em ativos de risco / A.L. Dantas. -- São Paulo, 2006.
67 p.

Dissertação (Mestrado) - Escola Politécnica da Universidade de São Paulo. Departamento de Engenharia de Telecomunicações e Controle.

1.Administração de carteiras (Otimização) 2.Controle (Teoria de sistema e controle) 3.Mercado financeiro I.Universidade de São Paulo. Escola Politécnica. Departamento de Engenharia de Telecomunicações e Controle II.t.