

TEMA 1: ACTIVIDADES

1. Un título cotiza al final de cierto trimestre a 42 €, y al final del siguiente a 42,50 €, habiendo percibido en el trimestre un dividendo de 1 €. Determinar:
 - a. Rentabilidad trimestral.
 - b. Rentabilidad mensual.
 - c. Rentabilidad anual.

2. Las acciones de cierta empresa cotizaron al final del pasado año a 120 € por acción. Durante el presente año, las cotizaciones al final de los siete primeros meses han sido las siguientes: 121,20; 123; 125; 124; 125,62; 127,32 y 128 € por acción. Determinar:
 - a. La rentabilidad de cada mes y rentabilidad media mensual (simple y continua).
 - b. A partir de la rentabilidad de todo el periodo, obtener la rentabilidad mensual.
 - c. A partir de la rentabilidad de todo el periodo, obtener la rentabilidad anual.
 - d. Comparar las distintas medidas de la rentabilidad.

3. Para dos activos se dispone de una muestra con cotizaciones mensuales.

	A	B	C
1	Cotizaciones		
2	Sesión	Activo A	Activo B
3	0	20,25	30,15
4	1	22,10	31,10
5	2	23,05	32,50
6	3	23,50	32,45
7	4	24,10	33,15
8	5	24,50	33,50
9	6	24,30	33,40
10	7	24,45	33,50
11	8	24,70	34,15
12	9	24,90	34,50
13	10	25,10	34,85
14	11	25,20	35,15
15	12	25,30	35,45

Determinar:

- a. Rentabilidad media mensual simple e instantánea.
- b. Riesgo mensual simple e instantáneo.
- c. La covarianza y el coeficiente de correlación lineal para rentabilidades simples y para rentabilidades continuas.

4. Los valores de la rentabilidad de dos activos son los siguientes

Activo j	Activo i
0,00%	2,00%
3,00%	4,70%
7,00%	8,30%
8,00%	9,20%
9,00%	10,10%

Calcular el coeficiente de correlación lineal y representar gráficamente las rentabilidades.