

## Prova de Computação e Finanças

Aluno: Lucas de Queiroz Silva e Silva  
DRE: 115197960

\*Para um desenvolvimento mais completo dos exercícios, ver arquivo "Prova.R".

### 1) Sharpe Ratio:

ABEV3	LREN3	GRND3	HGTX3	EZTC3	EGIE3	WEGE3	CIEL3
0.0008579999	0.0124489395	0.0091168794	-0.0145163014	-0.0056728158	0.0001910760	0.0105660662	0.0006023449

### 3) Pesos no Portfolio:

ABEV3	LREN3	GRND3	HGTX3	EZTC3	EGIE3	WEGE3	CIEL3
0.4783	-0.0333	-0.0102	-0.0253	-0.0608	0.4767	0.1013	0.0734

### 4) Pesos no Portfolio Eficiente:

ABEV3	0.272268794
LREN3	-0.040696211
GRND3	-0.008046934
HGTX3	-0.423210505
EZTC3	-0.233736963
EGIE3	0.982650166
WEGE3	0.488436153
CIEL3	-0.037664499

### 6) Pesos no Portfolio Tangente:

ABEV3	-0.034271509
LREN3	-0.051632762
GRND3	-0.004835225
HGTX3	-1.015246734
EZTC3	-0.491074522
EGIE3	1.735458577
WEGE3	1.064473335
CIEL3	-0.202871160

7)  $y = bx + a$ , onde  $b = (\mu_p - r_f) / \sigma_p$  e  $b = r_f$

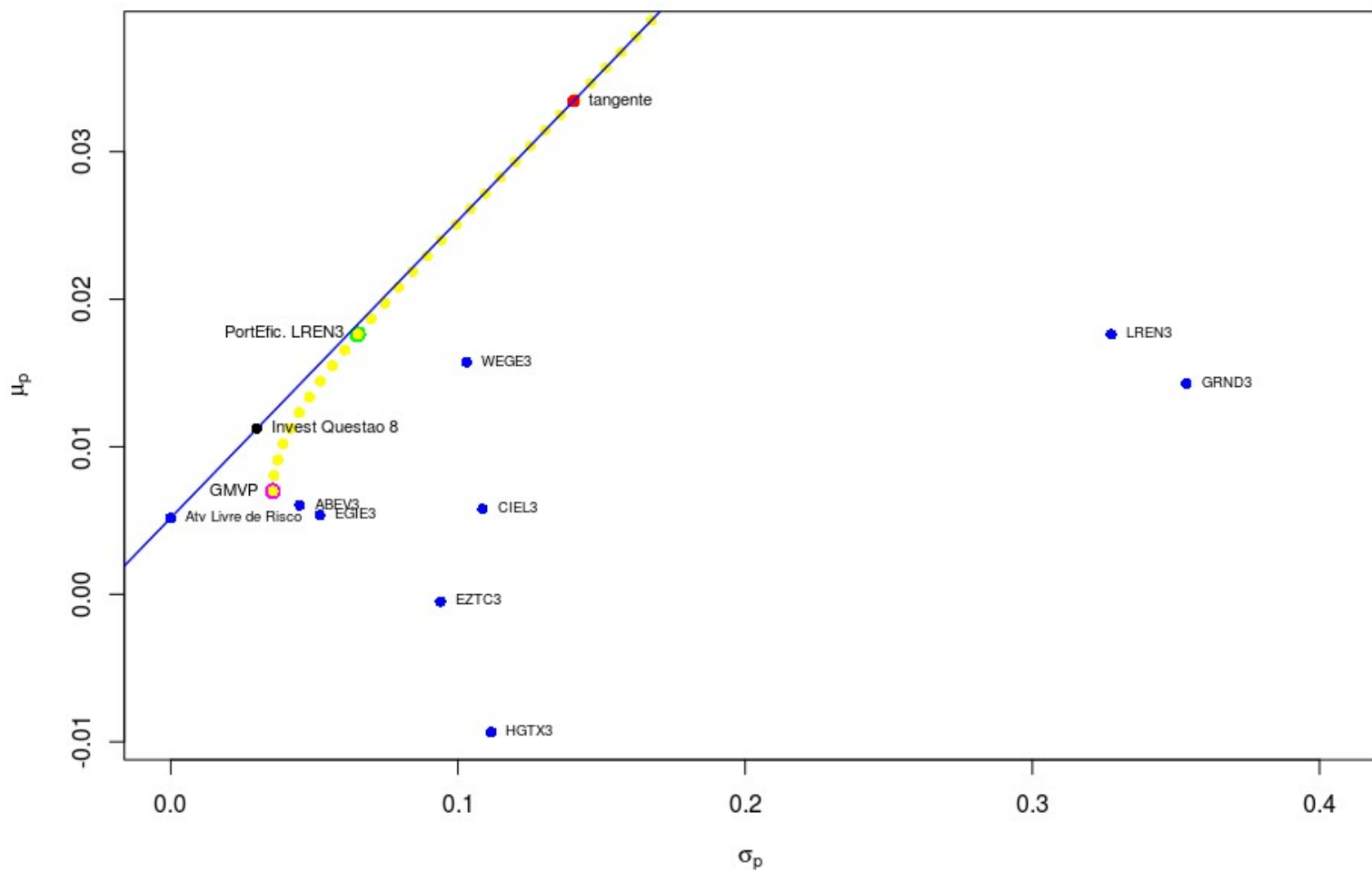


Grafico para questoes de 1 a 7

8) Valor alocado em renda fixa: 78612.15  
 Valor alocado em renda variável: 21387.85

9) Para 5% de chance, a perda máxima provável do portfolio é R\$3812.545

10)

