

ICP 103: Análise de Risco

Prof. Eber

Lista 06

Data: 20/05/2024

Entrega: 04/06/2024

Modelo CER de ativos correlacionados

1. Importar dados do Yahoo contendo a série histórica dos últimos 12 meses das ações da Petrobrás, Vale, Ambev e Banco do Brasil.
2. Estime os parâmetros do modelo CER de cada um dos ativos
3. Verifique a sua normalidade
4. Calcule a matriz de correlação empírica entre esses ativos.
5. Compare os resultados da simulação MC do CER correlacionado com os respectivos dados históricos.
6. Estime os valores dos ativos em Dezembro/2024