

UNIVERSIDADE FEDERAL DO CEARÁ
FACULDADE DE ECONOMIA, ADMINISTRAÇÃO, ATUARIAIS E CONTABILIDADE
CURSO DE CIÊNCIAS ATUARIAIS
DISCIPLINA: GESTÃO DE RISCOS E INVESTIMENTOS 1
PROF VITOR BORGES MONTEIRO
AVALIAÇÃO PARCIAL 1

QUESTÃO 01 (7 PONTOS)

O arquivo Base AP1.xlsx possui cotações de preço de fechamento de 10 (dez) ativos negociados na B3, no período de 03 de maio de 2021 a 03 de maio de 2022. Selecione 5 (cinco) ativos para construir a sua carteira de Investimentos.

Selecione o período de 03 de maio de 2021 a 31 de dezembro de 2021 para construir:

- a) Carteira de Variância Mínima 2,5 pontos.
- b) Carteira Eficiente 2,5 pontos.
- c) Gráfico da Fronteira Eficiente 2 pontos.

QUESTÃO 02 (3 PONTOS) No dia 31 de dezembro de 2021, construa uma carteira de equal wage para os seus 5 ativos. Faça o gráfico da rentabilidade acumulada de 31 de dezembro de 2021 a 03 de maio de 2022 da carteira de equal wage, carteira de variância mínima, carteira eficiente e índice Ibovespa.