

## Bootcamp: Cientista de Dados de Renda Variável

### Trabalho Prático

#### Módulo 4: Trabalho Prático

#### Objetivos de Ensino

Exercitar os seguintes conceitos trabalhados no Módulo:

1. Identificar as séries de dados relevantes para análise de risco e retorno em renda variável.
2. Calcular os principais indicadores de Risco para renda variável
3. Elaborar Dashboards com dados de renda variável.
4. Interpretar os relatórios criados com as métricas de risco.

#### Enunciado

Uma Asset Management faz a gestão conjunta de diversos fundos temáticos. Todos os fundos foram abertos no dia 30 de dezembro de 2019 e todos os ativos foram comprados no call de fechamento.

Cada fundo foi aberto com R\$ 10 milhões de reais, esse valor foi dividido igualmente em todas as 15 ações que compõe cada uma das carteiras.

Passados mais de 3 anos, os gestores resolveram contratar um cientista de dados para avaliar as principais métricas de risco desses portfólios e identificar desenquadramentos.

## Atividades

Os alunos deverão desempenhar as seguintes atividades:

1. Com base na Planilha MOD 4 – Risco e Retorno em Renda Variável – Base de dados, recrie as carteiras da aba Portifólios, assumindo alocação de valores financeiros iguais no dia 30/12/2019.
2. Crie uma tabela com os dados de Retorno, Volatilidade, Alfa, Beta, Sharpe e Sortino para cada um dos portfólios.
3. Crie uma tabela com os valores das posições de cada um dos portfólios desenvolvidos, e dê os dados da posição de cada um dos fundos na data de 30/03/2023, calcule o percentual de concentração de cada um dos portfólios e a porcentagem do ADTV dos últimos 30 dias que cada posição possui.
4. Em sua ferramenta de preferência, crie um dashboard interativo em que os gestores possam selecionar cada um dos fundos e verificar as métricas de risco e retorno.