Resumo

Os valores da fronteira eficiente dos setores de mineração e de alimentos ficaram muito próximos, dada a menor variação das empresas por fazerem parte do macro setor industrial.

Já no setor de varejo, as ações apresentam maior variação devido as maiores margens e exposição a variações no consumo. Dessa forma a sua fronteira eficiente apresentou um maior nível de risco-retorno,

Porém os melhore índices Sharpe foram os de carteiras com ativos de setores diferente onde foi possível aplicar maior diversificação de risco. E conforme esperado quanto maior o numero de ativos maior a diversificação de risco