

Utilize os dados “Monitoria4.xlsx” disponível no e-class para realizar os seguintes exercícios:

Questão 1

Usando a planilha disponível no e-class, obtenha os alfas para os fundos multimercado propostos. Utilize como fatores os 3 de Fama-French, o fator de momentum, o fator liquidez, fatores do termo da taxa de juros, a taxa de juros, inflação e câmbio. Faça um ranking desses alfas. A partir dos seus resultados que gestores apresentam um resultado diferenciado. Indique quais gestores apresentam estratégia parecida. Finalmente, qual estratégia vocês escolheriam?

Observação: Para os que não tem disponível o E-Views, o Excel faz regressões múltiplas. Seguindo o menu: Dados > análise de dados > regressão. Antes disso, você tem que ter instalado as opções de Excel > suplementos > ferramentas de análise.