

Lista de exercícios 2

Fundamentos de Finanças

Prof. Regis Augusto Ely

20 de janeiro de 2017

Os exercícios são do livro-texto *Elton et al (2012). Moderna teoria de carteiras e análise de investimentos*.

Capítulo 4

Exercícios: 1,3.

Capítulo 5

Exercícios: 4,5,6.

Capítulo 6

Exercícios: 1,4,5

Capítulo 7

Exercícios: 5,6.

Capítulo 8

Exercícios: 5.

Capítulo 14

Exercícios: 1.

2) Descreva as hipóteses principais do modelo de precificação de ativos (CAPM) e a equação principal desse modelo, interpretando cada um dos termos.

Capítulo 16

1) Descreva as hipóteses principais do modelo de precificação por arbitragem (APT) e a equação principal desse modelo, interpretando cada um dos termos.

Capítulo 17

1) O que as hipóteses de eficiência de mercado forte, semiforte e fraca nos dizem sobre o comportamento de retornos de ativos?

2) Qual a implicação da correlação temporal entre os retornos de um ativo para as hipóteses de eficiência elencadas na questão 1?

Capítulo 23

Exercícios: 4,5.