

Case Solaris

June 8, 2021

1. Se pudesse ajudar Susan a entender o que houve, como você explicaria?

O risco da carteira foi calculada erroneamente, visto que não considerou que todas as ações estão se movimentando em conjunto, ou seja, é necessário calcular, primeiramente, a matriz de covariância das médias dos retornos e depois utilizar a seguinte fórmula para o cálculo do risco do portfólio:

$$\alpha = \sqrt{wCw^T}$$

2. Salve Midas Capital. Ajude Susan e Gauss a compreenderem o acontecido para não cometerem novamente. O que pode ter acontecido?