



UNIVERSIDAD
NACIONAL
DE COLOMBIA

TALLER SEMANAL #7

ECONOMETRÍA FINANCIERA
PROGRAMA DE ECONOMÍA

SEMESTRE 2021 - 1

Los talleres semanales deben ser entregados de forma individual y serán sustentados de forma oral. Estos representan un 25% de la nota final del curso. Esta nota depende de que se hayan entregado la totalidad de los talleres y de la sustentación oral del estudiante. Si el estudiante sustenta varias veces durante el curso la nota corresponderá al promedio simple. La entrega se debe hacer escaneando la solución escrita de puño y letra del estudiante y enviandola al correo kgomezp@unal.edu.co

Sustente y explique su respuesta a cada una de las siguientes preguntas. Bajo el contexto del modelo CAPM

1. El portafolio de cualquier inversionista en un mundo CAPM esta afectado por riesgo no sistémico?
2. Bajo el modelo CAPM, el portafolio de mercado esta afectado por riesgo no sistémico?