*EAC0526 - Gestão de Riscos e Investimentos – Profa. Joanília Cia*

HOMEWORK 9

Um fundo de investimento tem somente dois ativos em carteira, X e Y, nos valores de 400 e 600 milhões, retornos de 25% e 35%, e desvio padrão de 20 e 30% respectivamente

1. Qual é a retorno esperado e o desvio padrão da carteira? (dica: usar fórmula de cálculo de desvio da carteira dado os desvio dos ativos)
2. Qual é a probabilidade do fundo perder dinheiro? Ou seja, qual é a probabilidade do fundo ter uma taxa de retorno negativa?
3. Se, nos próximos 365 dias, o banco enfrentar um cenário semelhante ao “pior ano dos últimos 100”, ou seja, a um nível de significância de 1% , para quanto irá o valor do fundo?
4. E quanto é o VaR (Valor em Risco) do fundo? O que ele significa?
5. E se o nível de significância for para 95%, o que acontece com o VaR?

