

Atividade #03
REC3600 – Finanças I

1 - Com base no arquivo EXCEL inserido no Moodle, contendo os preços de fechamento das ações da VALE e da PETR4 e a taxa SELIC entre 01/07/2020 e 09/10/2020, obter os seguintes:

- i Formar, em uma planilha EXCEL, carteiras de investimentos contendo ações da Vale do Rio Doce e Petrobrás. Para tanto, inicie distribuindo as participações relativas¹ (pesos) em relação ao total investido, como visto em aula;
- ii Calcule, por meio da rotina CORREL do EXCEL, o coeficiente de correlação entre os retornos das ações da Vale e da Petrobrás;
- iii Calcule o retorno esperado de cada carteira proposta;
- iv Calcule o risco de cada carteira proposta;
- v Calcule o Índice de Sharpe de cada carteira proposta e indique o maior valor desse indicador.

¹ Por exemplo, 0% para Vale e 100% para Petrobrás. Em seguida, 10% para Vale e 90% para Petrobrás e, assim por diante, até que se tenha 100% para Vale e 0% para Petrobrás.