

### Case 3

Considere a lista de empresas que fazem parte do índice S&P 500 Dow Jones (Excel edisciplinas).

1 - Escolha 3 ativos da lista com menor correlação entre eles e construa um modelo de otimização para determinar a carteira com menor risco para diferentes níveis de retorno. Construa o gráfico risco x retorno, indicando o *share* de cada ativo no gráfico.

2 - Escolha 3 ativos da lista com maior correlação entre eles e construa um modelo de otimização para determinar a carteira com menor risco para diferentes níveis de retorno. Construa o gráfico risco x retorno, indicando o *share* de cada ativo no gráfico.

3 – Compare os dois