

# Instruções – Trabalho Final

Claudio Ribeiro de Lucinda

February 10, 2016

Neste texto, estão as instruções para o trabalho final do curso. Cada grupo deve ter no máximo 4 pessoas, que será responsável por criar e analisar uma carteira de ativos financeiros (baseados em uma planilha Excel, acompanhados de uma apresentação em PowerPoint e, apenas quando necessário, um arquivo em Word). Neste trabalho, vocês escolherão 10 ações para incluir em uma carteira composta por um ativo livre de risco – o CDI – e uma parte de ativos arriscados que incluem as suas ações escolhidas. Vocês precisam:

- Fazer pesquisa das ações
- Calcular o desempenho histórico
- Calcular a correlação e covariância
- Calcular o Beta e o Alfa
- Relatar o que os analistas estão dizendo sobre as cinco mais importantes ações na carteira resultante (de acordo com o peso na sua carteira).

Vocês devem também incorporar restrições a venda a descoberto no seu problema de otimização de portfólio e investigar o efeito destas restrições sobre a fronteira eficiente.

## Regras Específicas:

- Espera-se que os projetos sejam apresentados de uma forma profissional em todas as partes que me forem entregues

- Seguir a análise deve ser fácil para o leitor (com as referências adequadas às tabelas relevantes no texto)
- Ainda que a análise possa se estender além das questões principais do texto, a resposta às questões que são pedidas deve ser facilmente discernível
- No mínimo:
  - Texto digitado e devidamente formatado. Inclua uma capa com os nomes dos integrantes, o título do projeto, o número do grupo, número USP. As páginas tem de ser numeradas
  - Planilhas e gráficos devem caber em uma página ou separados de uma forma lógica. Eles precisam ser bem formatados, com cabeçalhos e com uma descrição da análise
  - Se temos fórmulas envolvidas, anexe a Excel Formula Sheet ao Apêndice do trabalho (ou seja, imprima a planilha usando Tools/Options/View/Formulas para mostrar as fórmulas; amplie as células caso necessário para permitir que as mesmas sejam legíveis). O bom senso continua valendo. Não precisam me mostrar toda e qualquer fórmula envolvida em uma planilha de milhares de linhas, apenas o suficiente para se entender o que acontece
  - Todos os documentos precisam ser entregues em DUAS versões: impressa e eletrônica, sendo que a eletrônica tem que ser encaminhada pelo STOA. MESMO QUE ME ENTREGUE A VERSÃO EM PAPEL, PRECISO DA VERSÃO ELETRÔNICA