

Lista de Exercícios 3

Market Model

Para os N ativos do exercício anterior pede-se:

- 1) Escolha um ativo de mercado (R_{Mt}) e estime o Market Model para cada ativo com risco e construa a matriz de var-covar (Σ)
- 2) Faça a decomposição do risco de cada ativo individual e dos portfólios da fronteira-media-variância estimada no exercício anterior.
- 3) Quais ativos que contribuem para aumentar/diminuir o risco total do portfólio de tangência?