



FUNDACIÓN UNIVERSITARIA LUIS AMIGÓ
Especialización en Finanzas

Nombre: _____

Profesor: FERNANDO DE JESÚS FRANCO CUARTAS

Asignatura: Portafolio Renta Variable.

9/05/2009

Retroalimentación Final Individual de Conocimientos

1. Con base en la serie histórica diaria del índice – Dow - y de las acciones del Citigroup, C, determine: a) el porcentaje de riesgo controlable de los R(C) por el inversionista. b) Los R(Dow) y los R(C) se han comportado en forma directa o inversa y en qué proporción? c) Según el contexto de Markowitz, este par de activos serían ideales para lograr la diversificación? Sustente. d) El factor de ajuste al riesgo de mercado de los R(C) tiene relevancia estadística para estimar su comportamiento? Cuál ha sido su valor promedio, mínimo, máximo y su volatilidad en lo corrido del 2009. además, determine el factor de volatilidad de Chevichev e) Los rendimientos promedios libre de riesgo presentes en los títulos emitidos por la banca central estadounidense han predeterminado, estadísticamente ó no, los R(C)? Sustente. f) Si se pronostica una variación para mañana del 2.5% en los R(Dow) estime los R(C). g) Cuantifique la volatilidad y el valor esperado a 30 de Junio de 2009, para un NC del 95% para el valor del C. **Valor 70%.**
2. Determine el precio de venta antes de comisiones e IVA, si el inversionista desea obtener una rentabilidad del 1.5%, en una operación intradiaria al adquirir una acción por \$ 2320 y una comisión de compra de 0.8% y 0.5% en la venta. Sugerencia tenga en cuenta la función buscar objetivo. Cuál sería el impacto sobre la rentabilidad del 1.5% después de pagar el GMF – 4 por mil – **Valor 30%.**

Nota.

- Formato de entrega Excel.