**UNIVERSIDAD NACIONAL DE SALTA**

**FACULTAD DE CIENCIAS ECONOMICAS, JURIDICAS Y SOCIALES**

**CATEDRA: ADMINISTRACION FINANCIERA DE EMPRESAS II**

**UNIDAD VII: SELECCIÓN DE CARTERAS DE INVERSION**

**PLAN DE CONTINGENCIA 2020**

**FORMACION PRÁCTICA - TEMA II**

**OBJETIVOS:**

DEL TEMA

Fijar conceptos sobre carteras de inversión.

Practicar el cálculo de rentabilidades, volatilidades y correlaciones.

DE LA FORMACIÓN PRÁCTICA

Este práctico es continuación del anterior de riesgo. Se pretende reforzar los conocimientos de las herramientas para el cálculo de los rendimientos y desvíos de una cartera.

Recalcar nuevamente que los indicadores por sí solos no son suficientes para la toma de decisiones sin una acabada comprensión de las características de cada una de ellas.

De la resolución del mismo se deberá comprender que un solo indicador muchas veces puede ser contradictorio si no es analizado junto con otros elementos y teniendo en cuenta el juicio de valor o criterio de quien lo realiza.

**ENUNCIADO:**

Los rendimientos de distintos sectores de la economía durante los meses indicados tuvieron los siguientes rendimientos.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Mes | Sector A | Sector B | Sector C |
|
| Enero | 0,0345 | 0,1074 | -0,0200 |
| Febrero | 0,0579 | 0,1027 | -0,0102 |
| Marzo | -0,0184 | -0,0174 | 0,0052 |
| Abril | 0,0249 | 0,0133 | 0,0051 |
| Mayo | -0,0622 | -0,0620 | 0,0102 |
| Junio | -0,0344 | -0,0707 | -0,0051 |

**SE PIDE INFORME:**

1. ¿Cuál fue el rendimiento si no conformó ninguna cartera? Es decir, si hubiera invertido el 100% en cada sector.
2. ¿Cuál hubiera sido el riesgo en cada caso anterior?
3. Si conforma una cartera con el 33.33% en cada sector. ¿Cuál fue la rentabilidad de la misma? ¿Y cuál el desvío de la misma?