**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**

**SOLUCION - FORMACION PRÁCTICA - TEMA II**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 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:**

Cuál fue el rendimiento si hubiera invertido el 100% en cada sector?

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| SECTOR A | SECTOR B | SECTOR C |
| 0.04% | 1.22% | -0.25% |

¿Cuál hubiera sido el riesgo en cada caso anterior?

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| SECTOR A | SECTOR B | SECTOR C |
| 4.59% | 7.81% | 1.14% |

Si conforma una cartera con el 33.33% en cada sector. ¿Cuál fue la rentabilidad de la misma?

|  |
| --- |
| SECTOR A+B+C |
| 0.33% |

Y cuál el desvío de la misma

.

|  |
| --- |
| SECTOR A+B+C |
| 3.75% |