INSTITUTO POLITÉCNICO DE LEIRIA
ESCOLA SUPERIOR DE TECNOLOGIA E GESTÃO
CONTABILIDADE E FINANÇAS– DIURNO – TP1
FINANÇAS EMPRESARIAIS II

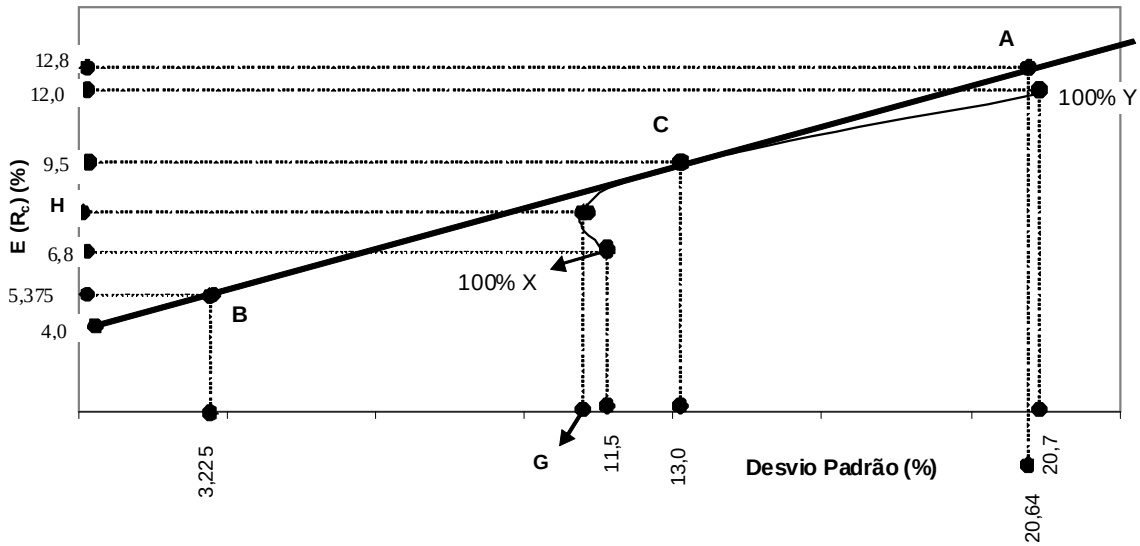
2º ANO – 1º SEMESTRE ANO LECTIVO 2008/2009

2º MINI-TESTE

Nome:_____

Nº aluno:_____ Curso/Turma:_____

1. Considere um mercado em que apenas são negociáveis as acções da empresa X, Y e títulos sem risco.



1.1 Sabendo que o coeficiente de correlação entre as acções da empresa X e Y é de 0,2, calcule os valores representados pelas letras G e H no gráfico.

1.2 Identifique os pontos extremos da carteira fronteira eficiente de Markowitz. Justifique.

1.3 Qual a expressão analítica da Linha de Mercado de Capitais neste caso.

1.4 Quais as percentagens de título sem risco, de título X e de título Y, necessárias para se obter a carteira A?

1.5 Sabendo que A e B são, respectivamente, os pontos óptimos de investimento para os investidores A e B: Qual dos dois investidores, A ou B, é mais avesso ao risco? Justifique.

1.6 Decomponha o risco total em risco sistemático e específico das acções da empresa X considerando que a covariância entre a rendibilidade das acções da empresa X e do mercado é de 0,01352.