Material realizado por J. David Moreno y María Gutiérrez - Documento bajo la Licencia BY-NC-SA

Caso empírico para realizar con Excel: Valores del IBEX35

En el archivo de Excel "Valores del Ibex35" usted encontrará los precios diarios de cierre del Ibex-35 y de cuatro de sus componentes desde el 1 de enero de 2011 hasta el 1 de julio de 2011. Utilizando esa información conteste a las siguientes preguntas.

a) Calcule la rentabilidad diaria media y las varianzas y covarianzas entre las rentabilidades.
b) Calcule también las rentabilidades medias anualizadas y en porcentaje (que es como generalmente expresaremos las rentabilidades).

c) Calcule la rentabilidad anualizada esperada de una cartera equiponderada de los cuatro títulos.

d) Calcule la beta de los valores tomando como cartera de mercado el IBEX35.

e) Calcule la beta de la cartera equiponderada de los cuatro valores.

f) Calcule la varianza y desviación típica diaria de una cartera con los siguientes pesos 50% en Acciona, 30% en Bankinter y 20% en Ebro Foods.