

Pregunta **1**

Incorrecte

Puntuació 0,00  
sobre 0,70

🚩 Marca la  
pregunta

Descargue el fichero [datos\\_prueba1](#).

Utilice los datos de la pestaña 7.

A partir de la fila 45 tiene datos de rentabilidades trimestrales de dos fondos de inversión copiadas de MORNINGSTAR. Sólo debe considerar las de los años 2016 a 2020.

En esta y las siguientes tres preguntas deberá calcular:

- la media de las rentabilidades simples anuales 2016 a 2020 de uno de los fondos.
- la covarianza de las rentabilidades anuales de los dos fondos
- el coeficiente de correlación de las rentabilidades anuales de los dos fondos

por lo que puede, quizás, plantear sus cálculos de una forma global.

En esta pregunta: calcule la media de las rentabilidades anuales simples del fondo UNO.

Se espera un valor con dos decimales que será leído como un porcentaje.

Resposta:  ✘

La respuesta correcta es: 1,10

Pregunta **2**

Incorrecte

Puntuació 0,00  
sobre 0,70

🚩 Marca la  
pregunta

Utilice los datos de la pestaña 7.

Calcule la DT de las rentabilidades anuales simples del fondo DOS. No olvide que está trabajando con una muestra.

Se espera un valor con dos decimales que será leído como un porcentaje.

Resposta:  ❌

La resposta correcta és: 12,19

Pregunta **3**

Incorrecte

Puntuació 0,00  
sobre 0,50

🚩 Marca la  
pregunta

Utilice los datos de la pestaña 7.

Calcule la covarianza de las rentabilidades anuales simples de los dos fondos.

Se espera un valor con cuatro decimales.

Resposta:  ❌

La resposta correcta és: 0,0023



Pregunta **4**

Incorrecte

Puntuació 0,00  
sobre 0,50

🚩 Marca la  
pregunta

Utilice los datos de la pestaña 7.

Calcule el coeficiente de correlación de las rentabilidades anuales simples de los dos fondos.

Se espera un valor con dos decimales.

Resposta:  ❌

La resposta correcta és: 0,86

Pregunta **5**

Correcte

Puntuació 0,70  
sobre 0,70

▶ Marca la  
pregunta

Utilice los datos de la pestaña 7.

En esta y las cuatro siguientes preguntas deberá calcular los siguientes parámetros:

- de una v.a. rentabilidad: la varianza
- de otra v.a. rentabilidad: la esperanza
- de otra v.a. rentabilidad: la DT
- de dos v.a. rentabilidad: la covarianza y el coeficiente de correlación

por lo que puede, quizás, plantear sus cálculos de una forma global.

Calcule la varianza de la rentabilidad del activo A.

Se espera un valor con cuatro decimales.

Resposta:



La resposta correcta és: 0,0356

Pregunta **6**

Correcte

Puntuació 0,80  
sobre 0,80

🚩 Marca la  
pregunta

Utilice los datos de la pestaña 7.

Calcule la esperanza de la rentabilidad del activo B.

Se espera un valor con dos decimales que será leído como un porcentaje.

Resposta:  ✓

La resposta correcta és: 0,14

Pregunta **7**

Correcte

Puntuació 0,80  
sobre 0,80

▶ Marca la  
pregunta

Utilice los datos de la pestaña 7.

Calcule la desviación típica de la rentabilidad del activo B.

Se espera un valor con dos decimales que será leído como un porcentaje.

Resposta:



La resposta correcta és: 4,94



Pregunta **8**

Correcte

Puntuació 0,70  
sobre 0,70

🚩 Marca la  
pregunta

Utilice los datos de la pestaña 7.

Calcule la covarianza de las rentabilidades de los activos A y B.

Se espera un valor con cuatro decimales.

Resposta:  ✓

La resposta correcta és: -0,0042



Pregunta **9**

Correcte

Puntuació 0,60  
sobre 0,60

🚩 Marca la  
pregunta

Utilice los datos de la pestaña 7.

Calcule el coeficiente de correlación de las rentabilidades de los activos A y B.

Se espera un valor con dos decimales.

Resposta:

-0,45



La resposta correcta és: -0,45

Pregunta **10**

Correcte

Puntuació 1,00  
sobre 1,00

🚩 Marca la  
pregunta

Utilice los datos de la pestaña 7.

A partir de la columna M tiene los datos de ER, varianzas y covarianzas de cuatro activos arriesgados y la rentabilidad del activo sin riesgo.

Supongamos un inversor que desea invertir 80.000 en la cartera de VM para una rentabilidad esperada del 5,70%, y que no tiene acceso al activo sin riesgo: sólo tiene acceso a los activos arriesgados. ¿Qué importe en EUR invertirá en la acción 4?

Se espera un valor sin decimales.

Resposta:

15165



La resposta correcta és: 15166

Pregunta **11**

Correcte

Puntuació 1,00  
sobre 1,00

🚩 Marca la  
pregunta

Utilice los datos de la pestaña 7.

¿Cuál es la DT de la cartera Tangente?

Se espera un valor con dos decimales que será leído como un porcentaje.

Resposta:  ✓

La resposta correcta és: 38,36



Pregunta **12**

No s'ha  
respost

Puntuat sobre  
1,00

🚩 Marca la  
pregunta

Utilice los datos de la pestaña 7.

El universo de activos que le es accesible son las acciones 1, 2, 3 y 4, y el activo F.

Su objetivo de DT es 33% ¿Cuál será el peso del activo sin riesgo en su cartera?

Se espera un valor con tres decimales.

Resposta:



La resposta correcta és: 0,140

Pregunta **13**

No s'ha  
respost

Puntuat sobre  
1,00

🚩 Marca la  
pregunta

Utilice los datos de la pestaña 7.

El universo de activos que le es accesible son las acciones 1, 2, 3 y 4, y el activo F.

Su objetivo de ER es 3,3% ¿Cuál será el peso del activo sin riesgo en su cartera?

Se espera un valor con tres decimales.

Resposta:



La resposta correcta és: 0,915