

Εργασία με θέμα το CAPM

Να εφαρμοσθεί το CAPM σε μία αγορά με 3 μετοχές και λαμβάνοντας υπόψη 100 τιμές ημερήσιες τιμές κλεισίματος για την εκτίμηση των beta. Δηλαδή να βρεθούν τα beta για κάθε μία μετοχή ξεχωριστά, σε σχέση με το χαρτοφυλάκιο της αγοράς που αποτελείται από αυτές τις τρεις μετοχές. Ως επιτόκιο λαμβάνεται η εκτίμηση του μέσου EURIBOR βάσει αυτών των 100 ημερών συναλλαγών.