

≡ 12

Questão 92

Media que calcula os níveis de risco esperados nas cotações de uma ação em relação ao risco de um índice de referência:

A Duration

Incorreto.

B Beta

O beta é o coeficiente da volatilidade de uma ação, é a covariância do retorno de uma ação em relação ao retorno do mercado. Mede níveis de risco esperados nas cotações de uma ação em relação ao risco de índice de referência. Estatisticamente, o beta estabelece uma relação de proporção entre a variação de mercado (variável independente) com a variação da ação (variável dependente).

C Correlação**D** Desvio Padrão

PRÓXIMA ATIVIDADE