

08

Calculando o Índice Beta

O índice beta é uma famosa ferramenta utilizada para medir a sensibilidade de um ativo em relação às oscilações dos preços e é também a principal medida de risco não diversificável.

O beta de um ativo é calculado pela Covariância entre um ativo e o retorno do mercado dividido pela variância do mercado. Veja os dados da tabela abaixo

Retorno ativo	Retorno mercado
1,5%	2,0%
-0,8%	0,5%
2,1%	1,5%
3,2%	1,25%
-1,5%	-1,0%

Com base nas informações da tabela e no que aprendemos, selecione a alternativa que representa o valor aproximado do índice Beta do ativo.

Selecione uma alternativa

A

O Beta do ativo é de aproximadamente 1,09.

B

O Beta do ativo é de aproximadamente 0,92.

C

O beta do ativo é de aproximadamente 0,98.

D

O Beta do ativo é de aproximadamente 1,15.