

Questão 132

Variância é uma medida de risco que é calculado como:

A

A raiz quadrada do desvio padrão



Incorreto.

B

A média dos retornos históricos



Incorreto.

C

A média mais o desvio padrão



Incorreto.



Desvio padrão elevada ao quadrado



A variância mede o grau de dispersão de um conjunto de dados é dado pelos desvios em relação a média desse conjunto. Seu valor pode ser obtido elevando-se o desvio padrão ao quadrado. A variância possui um problema de construção como medida de dispersão de dados: ela apresenta uma unidade de medida igual ao quadrado da unidade de medida dos dados originais. Esse problema é resolvido extraindo-se a raiz quadrada da variância, o que chamamos de desvio-padrão. No mercado financeiro, em geral é esse o valor que é chamado de volatilidade de um ativo e utilizado como principal medida de risco de se investir em determinado ativo.

PRÓXIMA ATIVIDADE