

20

Questão 80

Um investidor possui o ativo A em sua carteira e está em dúvida entre comprar os ativos B ou C:

Título	Beta	Desvio Padrão	Correlação com A
A	2	1,5%	-
B	1	3%	+0,70
C	1,50	25%	+0,60

Dado que o investidor deseja diminuir o impacto do risco sistêmico em sua carteira, e deverá escolher o ativo:

- A** C, pois tem o menor desvio padrão 

Incorreto.

- B** C, pois tem a maior correlação 

Incorreto.

-  **C**, pois tem o menor beta 

Correto.

- D** B, pois tem a menor correlação 

PRÓXIMA ATIVIDADE