

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.



B, pois tem o menor beta



Correto.

D B, pois tem a menor correlação



PRÓXIMA ATIVIDADE