

15

Questão 175

A medida que indica o grau de diversificação de uma carteira, segundo a Teoria Moderna de Investimentos, é:

A A média dos retornos dos ativos 

Incorreto.

B O desvio padrão dos retornos dos ativos 

Incorreto.

C A correlação dos retornos dos ativos  

A Covariância e a Correlação são medidas estatísticas que quantificam o grau de diversificação de uma carteira. Mensura a inter-relação entre duas variáveis. Como uma variável explica a outra. Quando seus valores forem: Positivo: Indica que as duas variáveis oscilam no mesmo sentido Negativo: indica que as duas variáveis oscilam em direções opostas Zero: indica que não é possível determinar o grau de diversificação entre os ativos.

D A mediana dos retornos dos ativos 

PRÓXIMA ATIVIDADE