

Questão 91

O Tracking error é uma medida que dará, assinale a alternativa correta:

A

A rentabilidade esperada de uma carteira



Incorreto.

B

O risco de uma carteira



Incorreto.

C

A máxima perda esperada de uma carteira



Incorreto.



O deslocamento de uma carteira em relação a um Benchmark



O tracking error é uma metodologia de avaliação de risco que avalia divergências não planejadas entre o valor da carteira de investimentos e o valor de um benchmark. Expresso através da variação do desvio padrão do retorno esperado do benchmark. Associado ao risco de base, que mede a variabilidade de retornos apresentada por modificações no diferencial entre dois indicadores.

PRÓXIMA ATIVIDADE