

≡ 11

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.

-  **D** 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