

## Investimentos

### Quiz #10 (20/Abr/12)

Nome: \_\_\_\_\_ Número: \_\_\_\_\_

Classifique as seguintes afirmações como verdadeiras ou falsas:

- É possível eliminar completamente o risco de uma carteira de activos com risco se combinarmos 2 activos com correlação igual a 0
- Regra geral, o conjunto de possibilidades de investimento expande-se se adicionarmos um activo com risco, mesmo que este se situe dentro do antigo conjunto de possibilidades de investimento
- Uma carteira completamente diversificada é uma carteira que só tem risco específico
- As carteiras situadas na fronteira eficiente de Markowitz são carteiras completamente diversificadas, ao contrário das carteiras que se situam no interior do conjunto de possibilidades de investimento
- A partir do momento em que consideramos a possibilidade de investir no activo sem risco, apenas uma carteira de activos com risco poderá vir a ser escolhida para integrar a carteira de investidores não saciáveis e avessos ao risco (excepto no caso em que  $r_f = E(r_{mvp})$ )
- A carteira de tangência, se existir, é sempre uma das carteiras da fronteira eficiente de Markowitz

Respostas:

- F (O risco é eliminado se combinarmos 2 activos com correlação de -1 ou um número infinito de activos com correlação de 0 entre si)
- V
- F (Uma carteira completamente diversificada só tem risco sistemático, ou seja, não tem risco específico)
- V
- V
- F (A carteira de tangência é sempre uma carteira da fronteira de variância mínima de Markowitz, mas tanto pode ser uma carteira eficiente como uma carteira ineficiente, dependendo do valor de  $r_f$  em relação ao valor de  $E(r_{mvp})$ )