

Questão 100

Quanto maior a duration de um título, marque a alternativa correta:



Maior será a sensibilidade do preço deste título em função das variações da taxa de juros

Duration tem decurso de tempo menor que o tempo do fluxo de caixa, porque parte dos rendimentos é recebida no pagamento de cupons (exceto nos títulos zero coupon, em que o duration será igual ao tempo do fluxo). Investidores utilizam a duration para medir a volatilidade do título. Em geral, quanto maior a duration mais cairá o preço do título, se a taxa de juros aumentar. Se a projeção dos juros é de queda, o preço do título tende a valorizar, porque o seu preço será mais compensador do que o dos títulos de prazo mais curto.

B

Menor será o não diversificável

C

Menor será a sensibilidade do preço deste título em função das variações da taxa de juros

D

Maior será o risco diversificável.

PRÓXIMA ATIVIDADE