

Consultoria divulga ranking de risco para ativos do setor bancário brasileiro

Por: Equipe InfoMoney
22/05/09 - 20h40
InfoMoney

SÃO PAULO - A consultoria de análise de risco Cymel International divulgou nesta sexta-feira (22) seu ranking dos papéis mais arriscados do setor bancário brasileiro, com a lista sendo encabeçada pelas ações ordinárias do Banco do Nordeste (**BNBR3**), com grau de risco 2,90, segundo a metodologia da empresa.

"O sistema que desenvolvemos aqui na Cymel sempre considera como marca de referência a carteira completa do Ibovespa, que representa o grau de risco igual a 1", explica Carlos Frederico S. Werneck, gerente de operações da instituição.

Na outra ponta do ranking, figuram entre os papéis menos arriscados as units do ABC Brasil, seguida pelas ações ordinárias do Itaú Unibanco (**ITUB3**), que, ao se considerar o estudo de cenários de estresse desenvolvido pela Cymel, seriam as mais expostas a uma variação do Ibovespa.

Paralelamente, os ativos ordinários do Banco Alfa (**BRIV3**) seriam os menos afetados pela volatilidade do índice.

Confira na tabela abaixo os 10 papéis com maior grau de risco:

Ativo	Código	Grau de Risco
Nord Brasil ON	BNBR3	2,90
Banrisul ON	BRSR3	2,88
Nord Brasil PN	BNBR4	2,76
Brasil BNS C	BBAS13	2,57
Alfa Financ ON	CRIV3	2,56
Sofisa ON	SFSA3	2,56
Merc Financ PN	MERC4	2,53
Banrisul PNA	BRSR5	2,31
Amazonia ON	BAZA3	2,22
Merc Invest PN	BMIN4	2,17

Confira na tabela abaixo os 10 papéis com menor grau de risco:

Ativo	Código	Grau de Risco
ABC Brasil unit	-	0,95
Itaú Unibanco ON	ITUB3	1,17
Bradesco ON	BBDC3	1,18
Alfa Invest ON	BRIV3	1,33
Bradesco PN	BBDC4	1,38
Alfa Financ PN	CRIV4	1,40
Nossa Caixa ON	BNCA3	1,41
Alfa Invest PN	BRIV4	1,44
Itaú Unibanco PN	ITUB4	1,46
Pine PN	PINE4	1,46