
22/05/2009 - 20:05

Ações do Banco do Nordeste são as mais arriscadas

As ações ordinárias do Banco do Nordeste lideram o ranking dos papéis mais arriscados do setor bancário, informou levantamento realizado pela Cynrel International, consultoria especializada em análise de risco. A pesquisa considerou as cotações da última quarta-feira (20) de todas as instituições financeiras de capital aberto e, segundo seu resultado, o grau de risco dos papéis estava em 2,90, ou seja, mais que o dobro do grau de risco da carteira teórica do Ibovespa. Atrás do Banco do Nordeste, ficaram as ações do Banrisul e do Banco do Nordeste PN, com grau de risco de 2,88 e 2,76, respectivamente

Já as ações que apresentam o menor grau de risco são os papéis preferenciais da ABC Brasil, com variação de 0,95, seguidos pelas ações do Itaú ON (1,17) e do Bradesco ON (1,19). "O grau de risco da ABC Brasil está muito próximo do risco da carteira teórica do Ibovespa", observou o gerente de operações da Cynrel, Carlos Frederico S. Werneck.

Considerando o estudo de cenários de estresse, o papel do ItaúUnibanco lidera. Pela análise da Cynrel, considerando a possibilidade de uma alta ou queda de 10% no Ibovespa, as ações ordinárias do ItaúUnibanco apresentariam a maior variação, podendo subir (ou cair) 9,95%. Já as ações do Banco Alfa seriam as menos afetadas, com possibilidade de alta ou queda de 0,02%.

Maior risco

Menor risco

Ativo Grau de risco Ativo Grau de risco

NORD BRASIL ON * 2,90 ABC BRASIL UNT 0,95

BANRISUL ON 2,88 Itaú Banco ON 1,17

NORD BRASIL PN 2,76 BRADESCO ON 1,18

BRASIL BNS C 2,57 ALFA INVEST ON 1,33

ALFA FINANC 2,56 BRADESCO PN 1,38

SOFISA ON 2,56 ALFA FINANC PN 1,40

MERC FINANC PN 2,53 NOSSA CAIXA ON 1,41

BANRISUL PNA 2,31 ALFA INVEST PN 1,44

AMAZONIA ON 2,22 ITAUBANCO PN 1,46

MERC INVEST PN 2,17 PINE PN 1,46