

Questão 116

O stop loss é um mecanismo utilizado em uma carteira de investimentos para limitar:

A

Seu VaR



Incorreto.

C

Suas perdas



O Stop Loss é a ferramenta utilizada quando os limites de VAR de uma carteira são ultrapassados. Por exemplo: Seja um Fundo que tenha um limite, definido em estatuto, de VAR de 1% em um dia, com 95% de confiança. Ou seja, o gestor deste Fundo não pode posicionar sua carteira de modo que possa perder mais que 1% do seu valor em um dia, com 95% de chances.

C

Seu nível de concentração de um ativo

**D**

Sua volatilidade histórica

[PRÓXIMA ATIVIDADE](#)