

≡ 20

**Questão 180**

É uma medida monetária que avalia qual a perda máxima que uma carteira pode ter dentro de horizonte pré-determinado e supondo um Nível de Significância ou um Intervalo de Confiança estatístico pré-determinado e uma dada distribuição de probabilidade dos retornos do ativo - geralmente supõe-se a distribuição normal:

**A** Back testing

Incorreto.

**B** Stop loss

Incorreto.

**C** Stress testing

Incorreto.

**✓** Value at Risk – VaR

O cálculo do Valor em Risco (ou VAR) é um método de se obter o valor esperado da máxima perda (ou pior perda) dentro de um horizonte de tempo com um intervalo de confiança.

PRÓXIMA ATIVIDADE