

GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

Matrícula: 2222291 Nome: EDUARDO FERIOLI GOMES

Classe: ASSISTENTE A - PROFESSOR DO MAGISTERIO SUPERIOR  
 Titulação: MESTRADO ACADÊMICO

Nível :

Reg. Trabalho Semanal : DE

Assinatura : \_\_\_\_\_

Aprovado na reunião do Departamento de 15 de 06 de 2018

JONY ARRAIS PINTO JUNIOR  
 Chefe Depto de Estatística  
 SIAPE 2722748

Assinatura do Chefe do Departamento *Jony Arrais Pinto Junior*

*Professor Celso Costa*  
 Diretor do Instituto de Matemática e Estatística  
 SIAPE 03047414

Visto do Diretor da Unidade *Celso Costa*

**Administração**

Função ou Atividade	Tipo	Órgão	Ato de Designação	CH
COORDENADOR DE ESTÁGIO	COORDENADOR DE ESTÁGIO	UFF		90
MEMBRO	COMISSAO PERMANENTE	UFF		90
DOCENTE	REUNIÃO - DEPARTAMENTO, CONSELHOS, ETC	UFF		1
MEMBRO DA COMISSÃO ORGANIZADORA	ORGANIZAÇÃO DE EVENTOS ACADEMICOS	UFF		120

**Afastamento(s) informado(s) pelo docente**

Motivo	Instituição	CH
Participação no LASNPA-WONP-NURT 2017 ministrando o GET minicurso Perfect Simulation Spitzer Model: An Application Approach.	AGENCIA INTERNACIONAL DE ENERGIA ATÔMICA	45

**Aula de Graduação**

Período	Disciplina	Turma	Modalidade	Cod.Emec/Num Alunos	Carga Horária Anual			
					Teórica	Prática	Estági	Acess
1/2017	FUNDAMENTOS DE ESTATISTICA APLICADA	C1	PRESENCIAL	12701-25	60	0	0	120
1/2017	METODOLOGIA DA PESQUISA CIENTÍFICA	AA	PRESENCIAL	99082-13	0	34	0	68
1/2017	METODOLOGIA DA PESQUISA CIENTÍFICA	A1	PRESENCIAL	99082-13	34	0	0	68
2/2017	METODOLOGIA DA PESQUISA CIENTÍFICA	AA	PRESENCIAL	99082-13	0	34	0	68
2/2017	METODOLOGIA DA PESQUISA CIENTÍFICA	A1	PRESENCIAL	99082-13	34	0	0	68
2/2017	MODELOS LINEARES I	AA	PRESENCIAL	99082-22	0	34	0	68
2/2017	MODELOS LINEARES I	A1	PRESENCIAL	99082-22	68	0	0	136

**Exercício: 2017**
**GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA**
**Especial**

Descrição	Instituição	Carga Horária Anual	
		Atividade	Acessória
PARTICIPAÇÃO NA LINHA DE PESQUISA EM DINÂMICA INDUSTRIAL NO GRUPO DE ORGANIZAÇÃO INDUSTRIAL EMPÍRICA DO IE/UFRJ.	UNIVERSIDADE FEDERAL DO RIO DE JANEIRO	400	0

**Pesquisa**

Resumo da Atividade	Projeto de Pesquisa	Carga Horária Anual	
		Atividade	Acessória
<p>O SEGUNDO ACORDO DE BASILÉIA EXIGIU QUE BANCOS E DEMAIS INSTITUIÇÕES DE CAPTAÇÃO DE DEPÓSITOS COMUNICASSEM ARIAMENTE SUAS PREVISÕES DE RISCO ÀS AUTORIDADES MONETÁRIAS COMPETENTES. OS RISCOS INFORMADOS, POR SUA VEZ, DEVERIAM CORRESPONDER A ESTIMATIVAS DO VALOR EM RISCO [VALUE-AT-RISK OU VAR] - BASEL (2006). O VAR [TAMBÉM VARALFA] DE UM ATIVO INDICA A PERDA MÁXIMA ESPERADA EM UM DADO NÍVEL DE SIGNIFICÂNCIA ALFA, FIXADO UM CERTO HORIZONTE DE TEMPO. A PROBABILIDADE DE OBTER UMA PERDA MAIOR QUE O VAR DEVE SER MENOR OU IGUAL QUE ALFA. O VAR CORRESPONDE, DESSA FORMA, AO ALFA-QUANTIL DA DISTRIBUIÇÃO DOS RETORNOS DO ATIVO [MULTIPLICADO POR MENOS UM, POR CONVENÇÃO]. COMO PODERÁ SER VISTO NA REVISÃO BIBLIOGRÁFICA, HÁ UMA VASTA GAMA DE METODOLOGIAS EMPREGADAS PARA ESTIMAR O VAR E UM CONJUNTO DE TESTES DESENVOLVIDOS PARA COMPARAR TAIS METODOLOGIAS. NOSSO OBJETIVO É UTILIZAR O TESTE DESENVOLVIDO EM GAGLIONE ET. AL. (2011) PARA COMPARAR AS METODOLOGIAS DE ESTIMAÇÃO MAIS UTILIZADAS EM UM ESTUDO VIA SIMULAÇÕES. NENHUM ESTUDO COMPARATIVO NOS MOLDES DE LIMA &amp; NÉRI (2007) FOI FEITO UTILIZANDO TAL PROPOSTA. ACREDITAMOS QUE COMPARAR OS PRINCIPAIS MODELOS PROPOSTOS PARA ESTIMAÇÃO DO VAR COM BASE NO PROCEDIMENTO SUGERIDO POR GAGLIONE ET. AL. (2011) SEJA UMA CONTRIBUIÇÃO RELEVANTE. DESSA FORMA, O PRIMEIRO ESFORÇO DE CONSOLIDAR E MAPEAR O RESULTADO DESTAS CONTRIBUIÇÕES JÁ É, EM SI, UMA GRANDE CONTRIBUIÇÃO. POR OUTRO LADO, HÁ DE SE RECONHECER QUE O INTERESSANTE TESTE PROPOSTO EM GAGLIONE ET. AL. (2011) É RELATIVAMENTE RECENTE. ISSO POSSIVELMENTE EXPLICA O FATO DE TAL PROCEDIMENTO NÃO TER SIDO EMPREGADO PARA FAZER COMPARAÇÕES COMO AS QUE GOSTARÍAMOS DE FAZER. SOMADO AO FATO DE QUE NOVAS METODOLOGIAS ESTÃO SENDO CONSTANTEMENTE PROPOSTAS, JULGAMOS NECESSÁRIO AVALIAR QUAIS SERIAM AS MAIS RECOMENDADAS PELA METODOLOGIA DE GAGLIONE ET. AL. (2011). ESPERAMOS QUE, AO COMPARAR METODOLOGIAS PARA ESTIMAÇÃO DO VAR BASEANDO-SE NO TESTE DE REGRESSÃO QUANTÍLICA (E OUTROS MAIS TRADICIONAIS COMO O "UNCONDITIONAL COVERAGE BACKTEST", PROPOSTO POR KUPIEC (1995), POR EXEMPLO) POSSAMOS IDENTIFICAR UM CONJUNTO DE MELHORES METODOLOGIAS OU UMA MELHOR METODOLOGIA PARA A ESTIMAÇÃO DO VAR. NO QUE DIZ RESPEITO, EM PARTICULAR, À ANÁLISE DA PERFORMANCE COM SÉRIES REAIS, ESPERAMOS QUE HAJA HIERARQUIA DAS METODOLOGIAS AO MENOS PARA ALGUMAS CLASSES DE SÉRIES [PREÇOS DE COMMODITIES, POR EXEMPLO] E SERIA INTERESSANTE</p>	<p>AVALIANDO METODOLOGIAS DE ESTIMAÇÃO DO VALOR EM RISCO SEGUNDO TESTE BASEADO NA REGRESSÃO QUANTÍLICA</p>	200	0

Exercício: 2017

## GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

## Pesquisa

Carga Horária Anual

Resumo da Atividade

Projeto de Pesquisa

Atividade Acessória

CONHECER OU IDENTIFICAR TAIS CLASSES

## Projeto(s)

## Projeto: 1

Tipo: PROJETO DE PESQUISA Perfil: Colaborador  
Título: AVALIANDO METODOLOGIAS DE ESTIMAÇÃO DO VALOR EM RISCO SEGUNDO TESTE BASEADO NA REGRESSÃO QUANTÍLICA  
Departamento: DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA  
Curso:  
Aprovação: 23/09/2016 Financiamento: NÃO POSSUI  
Início: 23/09/2016  
Final: 28/02/2018  
Moeda:  
Valor: 0

Resumo: O SEGUNDO ACORDO DE BASILÉIA EXIGIU QUE BANCOS E DEMAIS INSTITUIÇÕES DE CAPTAÇÃO DE DEPÓSITOS COMUNICASSEM DIARIAMENTE SUAS PREVISÕES DE RISCO ÀS AUTORIDADES MONETÁRIAS COMPETENTES. OS RISCOS INFORMADOS, POR SUA VEZ, DEVERIAM CORRESPONDER A ESTIMATIVAS DO VALOR EM RISCO [VALUE-AT-RISK OU VAR] - BASEL (2006). O VAR [TAMBÉM VAR-ALFA] DE UM ATIVO INDICA A PERDA MÁXIMA ESPERADA EM UM DADO NÍVEL DE SIGNIFICÂNCIA ALFA, FIXADO UM CERTO HORIZONTE DE TEMPO. A PROBABILIDADE DE OBTER UMA PERDA MAIOR QUE O VAR DEVE SER MENOR OU IGUAL QUE ALFA. O VAR CORRESPONDE, DESSA FORMA, AO ALFA-QUANTIL DA DISTRIBUIÇÃO DOS RETORNOS DO ATIVO [MULTIPLICADO POR MENOS UM, POR CONVENÇÃO]. COMO PODERÁ SER VISTO NA REVISÃO BIBLIOGRÁFICA, HÁ UMA VASTA GAMA DE METODOLOGIAS EMPREGADAS PARA ESTIMAR O VAR E UM CONJUNTO DE TESTES DESENVOLVIDOS PARA COMPARAR TAIS METODOLOGIAS. NOSSO OBJETIVO É UTILIZAR O TESTE DESENVOLVIDO EM GAGLIONE ET. AL. (2011) PARA COMPARAR AS METODOLOGIAS DE ESTIMAÇÃO MAIS UTILIZADAS EM UM ESTUDO VIA SIMULAÇÕES. NENHUM ESTUDO COMPARATIVO NOS MOLDES DE LIMA & NÉRI (2007) FOI FEITO UTILIZANDO TAL PROPOSTA. ACREDITAMOS QUE COMPARAR OS PRINCIPAIS MODELOS PROPOSTOS PARA ESTIMAÇÃO DO VAR COM BASE NO PROCEDIMENTO SUGERIDO POR GAGLIONE ET. AL. (2011) SEJA UMA CONTRIBUIÇÃO RELEVANTE. DESSA FORMA, O PRIMEIRO ESFORÇO DE CONSOLIDAR E MAPEAR O RESULTADO DESTAS CONTRIBUIÇÕES JÁ É, EM SI, UMA GRANDE CONTRIBUIÇÃO. POR OUTRO LADO, HÁ DE SE RECONHECER QUE O INTERESSANTE TESTE PROPOSTO EM GAGLIONE ET. AL. (2011) É RELATIVAMENTE RECENTE. ISSO POSSIVELMENTE EXPLICA O FATO DE TAL PROCEDIMENTO NÃO TER SIDO EMPREGADO PARA FAZER COMPARAÇÕES COMO AS QUE GOSTARIAMOS DE FAZER. SOMADO AO FATO DE QUE NOVAS METODOLOGIAS ESTÃO SENDO CONSTANTEMENTE PROPOSTAS, JULGAMOS NECESSÁRIO AVALIAR QUAIS SERIAM AS MAIS RECOMENDADAS PELA METODOLOGIA DE GAGLIONE ET. AL. (2011). ESPERAMOS QUE, AO COMPARAR METODOLOGIAS PARA ESTIMAÇÃO DO VAR BASEANDO-SE NO TESTE DE REGRESSÃO QUANTÍLICA (E OUTROS MAIS TRADICIONAIS COMO O "UNCONDITIONAL COVERAGE BACKTEST", PROPOSTO POR KUPIEC (1995), POR EXEMPLO) POSSAMOS IDENTIFICAR UM CONJUNTO DE MELHORES METODOLOGIAS OU UMA MELHOR METODOLOGIA PARA A ESTIMAÇÃO DO VAR. NO QUE DIZ RESPEITO, EM PARTICULAR, À ANÁLISE DA PERFORMANCE COM SÉRIES REAIS, ESPERAMOS QUE HAJA HIERARQUIA DAS METODOLOGIAS AO MENOS PARA ALGUMAS CLASSES DE SÉRIES [PREÇOS DE COMMODITIES, POR EXEMPLO] E SERIA INTERESSANTE CONHECER OU IDENTIFICAR TAIS CLASSES.