

**GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA**

Matrícula: 2197625 Nome: WILSON CALMON ALMEIDA DOS SANTOS

Classe: ASSISTENTE A - PROFESSOR DO MAGISTERIO SUPERIOR

Titulação: DOUTORADO

Nível :

Reg. Trabalho Semanal : DE

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

Aprovado na reunião do Departamento de 15 de 06 de 2018

Assinatura do Chefe do Departamento Jony Arrais Pinto Junior

Visto do Diretor da Unidade Celso Costa

**JONY ARRAIS PINTO JUNIOR**  
 Chefe Depto de Estatística  
 SIAPE 2722748

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

**Administração**

| Função ou Atividade                                | Tipo                  | Orgão | Ato de Designação                                      | CH |
|--|-----------------------|-------|--|----|
| MEMBRO DO DEPARTAMENTO - REUNIÕES DEPARTAMENTAIS   | COMISSAO PERMANENTE   | GET   | reunião  | 20 |
| REPRESENTANTE DA ESTATÍSTICA COLEGIADO ECONOMIA    | TEMPORÁRIA - COMISSÃO | GET   | reuniões   | 3  |
| SUPLANTE NO COLEGIADO DO IME, REPRESENTANTE DO GET | SUPLANTE DE COLEGIADO | GET   | reuniões   | 12 |
| AVALIADOR DE PROJETOS, COMISSÃO DE ENSINO          | TEMPORÁRIA - COMISSÃO | GET   | Avaliação de Projetos de Ensino e Iniciação à Docência | 20 |

**Aula de Graduação**

| Período | Disciplina                                 | Turma | Modalidade | Cod.Emec/Num Alunos  | Carga Horária Anual |         |        |       |
|---------|--|-------|------------|--|---------------------|---------|--------|-------|
|         |  |       |            |  | Teórica             | Prática | Estági | Acess |
| 1/2017  | ESTATÍSTICA BÁSICA PARA ENGENHARIA         | D1    | PRESENCIAL | 12718-4<br>12719-5<br>12720-6<br>12721-15<br>12728-3<br>90473-1  | 60                  | 0       | 0      | 120   |
| 1/2017  | ESTATÍSTICA BÁSICA PARA ENGENHARIA         | E1    | PRESENCIAL | 12728-2<br>100670-8<br>12718-6<br>12720-10<br>12721-6<br>12727-8 | 60                  | 0       | 0      | 120   |
| 2/2017  | METOD ESTAT APLICADOS A ECONOMIA II        | A1    | PRESENCIAL | 12698-37<br>100670-1   | 60                  | 0       | 0      | 120   |
| 2/2017  | FUNDAMENTOS DE MATEMÁTICA PARA ESTATÍSTICA | A1    | PRESENCIAL | 99082-41   | 68                  | 0       | 0      | 136   |

**Especial**

| Descrição   | Instituição                     | Carga Horária Anual |           |
|---|---------------------------------|---------------------|-----------|
|   |                                 | Atividade           | Acessória |
| GRADUAÇÃO COMPARANDO O PODER PREDITIVO DE PROCESSOS | UNIVERSIDADE FEDERAL FLUMINENSE | 2                   | 8         |

**GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA**
**Especial**

| Descrição   | Instituição                     | Carga Horária Anual |           |
|---|---------------------------------|---------------------|-----------|
|   |                                 | Atividade           | Acessória |
| COX LOG-GAUSSIANOS: UMA ABORDAGEM VIA WAIC E VALIAÇÃO CRUZADA<br>-2017 - BRASIL<br>- PORTUGUÊS<br>BRUNO LEONARDO DOS SANTOS NOBREGA<br>ESTATÍSTICA  |                                 |                     |           |
| GRADUAÇÃO<br>TESTE DA RAZÃO DE VEROSSIMILHANÇA VIA BOOTSTRAP EM MODELOS NÃO ENCAIXADOS<br>-2017 - BRASIL<br>- PORTUGUÊS<br>DANIEL DA SILVA OLIVEIRA<br>ESTATÍSTICA  | UNIVERSIDADE FEDERAL FLUMINENSE | 2                   | 8         |
| GRADUAÇÃO<br>ESTIMANDO O TAMANHO DE POPULAÇÕES DE DIFÍCIL ACESSO USANDO O MÉTODO NETWORK SCALE-UP<br>-2017 - BRASIL<br>- PORTUGUÊS<br>YASMIN FERREIRA CAVALIERE<br>ESTATÍSTICA  | UNIVERSIDADE FEDERAL FLUMINENSE | 2                   | 8         |
| GRADUAÇÃO<br>ABORDAGEM SINGULAR SPECTRUM ANALYSIS NA PREVISÃO DE FATURAMENTO DE UMA EMPRESA DE SANEAMENTO BÁSICO NO ESTADO DO RIO DE JANEIRO<br>-2017 - BRASIL<br>- PORTUGUÊS<br>ISABELLA PERRUT PEREIRA SOARES PHILBERT<br>ESTATÍSTICA | UNIVERSIDADE FEDERAL FLUMINENSE | 2                   | 8         |

**Orientação**

| Aluno                            | Semestre | Tipo                           | Nível     | Órgão | Curso               |
|----------------------------------|----------|--------------------------------|-----------|-------|---------------------|
| LEONARA ALVES CESARIO DA SILVA   | ANUAL    | TRABALHO DE CONCLUSÃO DE CURSO | GRADUAÇÃO | GET   | ESTATÍSTICA         |
| LUIA SANTORO TEIXEIRA PONTES     | ANUAL    | TRABALHO DE CONCLUSÃO DE CURSO | GRADUAÇÃO | GET   | ESTATÍSTICA         |
| THAYLLA CAROLINA FRANKLIN ALVES  | ANUAL    | TRABALHO DE CONCLUSÃO DE CURSO | GRADUAÇÃO | GET   | ESTATÍSTICA         |
| KAROLINA NASCIMENTO DE MELO      | ANUAL    | INICIAÇÃO CIENTÍFICA           | GRADUAÇÃO | GET   | ESTATÍSTICA         |
| JOHANN RODRIGUES DE SOUZA SOARES | ANUAL    | INICIAÇÃO CIENTÍFICA           | GRADUAÇÃO | GET   | CIÊNCIAS ECONÔMICAS |
| JOHANN RODRIGUES DE SOUZA SOARES | ANUAL    | INICIAÇÃO CIENTÍFICA           | GRADUAÇÃO | GET   | CIÊNCIAS ECONÔMICAS |
| JOAO VITOR DE AZEVEDO BASTOS     | ANUAL    | TRABALHO DE CONCLUSÃO DE CURSO | GRADUAÇÃO | GET   | ESTATÍSTICA         |
| DAVI SAADI DE ALMEIDA LETTIERI   | ANUAL    | INICIAÇÃO CIENTÍFICA           | GRADUAÇÃO | GET   | ENGENHARIA MECÂNICA |

GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

Orientação

| Aluno                        | Semestre | Tipo | Nível | Órgão | Curso |
|------------------------------|----------|------|-------|-------|-------|
| TOTAL DE HORAS DE ORIENTAÇÃO |          |      |       |       |       |
| 488                          |          |      |       |       |       |

Pesquisa

| Resumo da Atividade  | Projeto de Pesquisa  | Carga Horária Anual |           |
|--|--|---------------------|-----------|
|  |  | Atividade           | Acessória |
| <p>O SEGUNDO ACORDO DE BASILÉIA EXIGIU QUE 220 0 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). EXISTEM DIVERSAS METODOLOGIAS PROPOSTAS PARA A ESTIMAÇÃO DO VAR E, VIA DE REGRA, ELAS SÃO AVALIADAS E/OU COMPARADAS POR MEIO DA APLICAÇÃO DE ALGUM TESTE USUALMENTE CHAMADO DE BACKTESTING. GAGLIONE ET. AL. (2011) APRESENTOU UM BACKTESTING ALTERNATIVO, BASEADO NO USO DA REGRESSÃO QUANTÍLICA E QUE APRESENTA MELHORES PERFORMANCES QUE OS USUAIS - POR EXEMPLO, O TRADICIONAL TESTE BINOMIAL APRESENTADO EM KUPIEC (1995). EMBORA EXISTAM VÁRIAS CONTRIBUIÇÕES NA LITERATURA COMPARANDO METODOLOGIAS DE ESTIMAÇÃO DO VAR COMO EM LIMA &amp; NÉRI (2007), NENHUM DELÉS FOI FEITO AINDA UTILIZANDO O TESTE PROPOSTO EM GAGLIONE ET. AL. (2011). O PRESENTE TRABALHO TENTA COLABORAR NA DIREÇÃO DE PREENCHER ESTA LACUNA.</p> | <p>AVALIANDO METODOLOGIAS DE ESTIMAÇÃO DO VALOR EM RISCO SEGUNDO TESTE BASEADO NA REGRESSÃO QUANTÍLICA</p> | 513                 | 0         |

Projeto(s)

Projeto: 1

|               |   |                |             |
|---------------|---|----------------|-------------|
| Tipo:         | PROJETO DE PESQUISA   | Perfil:        | Responsável |
| 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

GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

**Projeto(s)**

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.