

PROVA DISCURSIVA

- Nesta prova, faça o que se pede, usando, caso deseje, o espaço para rascunho indicado no presente caderno. Em seguida, transcreva o texto para a **FOLHA DE TEXTO DEFINITIVO DA PROVA DISCURSIVA**, no local apropriado, pois **não serão avaliados fragmentos de texto escritos em locais indevidos**.
- Qualquer fragmento de texto que ultrapassar a extensão máxima de linhas disponibilizadas será desconsiderado.
- Na **folha de texto definitivo**, identifique-se apenas no cabeçalho da primeira página, pois não será avaliado texto que tenha qualquer assinatura ou marca identificadora fora do local apropriado. Ao texto que contenha outra forma de identificação será atribuída nota zero, correspondente à identificação do candidato em local indevido.
- Ao domínio do conteúdo serão atribuídos até **40,00 pontos**, dos quais até **2,00 pontos** serão atribuídos ao quesito apresentação (legibilidade, respeito às margens e indicação de parágrafos) e estrutura textual (organização das ideias em texto estruturado).

Considere que o risco de mercado tenha sido avaliado pela metodologia do *value at risk* (VaR). Nesse sentido, redija um texto dissertativo que contenha:

- ▶ um diagnóstico dos problemas e dos benefícios de se utilizar o cálculo do VaR não paramétrico; [valor: 9,50 pontos]
- ▶ hipóteses formais do modelo *value at risk*; [valor: 9,50 pontos]
- ▶ comparação e discussão dessas hipóteses e suas relações com a abordagem paramétrica de cálculo; [valor: 9,50 pontos]
- ▶ discussão e avaliação de qual o intervalo mínimo de tempo a ser utilizado para o cálculo do VaR. [valor: 9,50 pontos]

RASCUNHO

1	
2	
3	
4	
5	
6	
7	
8	
9	
10	
11	
12	
13	
14	
15	
16	
17	
18	
19	
20	
21	
22	
23	
24	
25	
26	
27	
28	
29	
30	