

- 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 será avaliado fragmento de texto escrito em local indevido**.
- Qualquer fragmento de texto além da extensão máxima de linhas disponibilizadas será desconsiderado.
- Na **Folha de Texto Definitivo**, a presença de qualquer marca identificadora no espaço destinado à transcrição do texto definitivo acarretará a anulação da sua prova discursiva.
- Ao domínio do conteúdo serão atribuídos até **10,00 pontos**, dos quais até **0,50 ponto** será atribuído ao quesito apresentação (legibilidade, respeito às margens e indicação de parágrafos) e estrutura textual (organização das ideias em texto estruturado).

## PROVA DISCURSIVA

Considerando que as posições financeiras de uma empresa de telecomunicações estejam sujeitas ao risco de mercado, especificamente em relação às flutuações de taxas de juros, e que o mercado financeiro brasileiro adota o padrão temporal de dias úteis, redija um texto dissertativo apresentando um modelo de cálculo de Valor em Risco (VaR) para a empresa.

Em seu texto,

- 1 defina o risco de mercado; [valor: 3,00 pontos]
- 2 apresente e discuta o intervalo de confiança para o VaR que a empresa deve adotar; [valor: 3,00 pontos]
- 3 discuta se o modelo deve seguir uma distribuição paramétrica, não paramétrica ou se o gestor de riscos pode adotar medidas complementares para garantir uma boa métrica quantitativa de mensuração dos riscos. [valor: 3,50 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	