Relatório de Estágio

Aluno(a):[redacted]

RA:[redacted]

Empresa:[redacted]A.

Resumo das atividades informadas no projeto inicial

O estágio ocorreu durante o período de dois meses, do dia 3 de janeiro de[redacted]até dia 24 de fevereiro de[redacted]com a carga horária de 30 horas semanais. As atividades realizadas durante o estágio foram:

- realizar levantamento de cópulas disponíveis na literatura;

- realizar levantamento de hipóteses de cópulas;

- realizar estudo de impacto sobre como as cópulas abordadas impactam de premissas adotadas pelo modelo;

O projeto se insere dentro de um projeto maior em que o objetivo é estimar o capital alocado para perdas operacionais do banco.

Descrição das ferramentas estatísticas utilizadas na execução do projeto

O projeto se concentrou no estudo de cópulas aplicado a risco operacional. Foi necessário conhecimento de probabilidade, inferência e análise multivariada para entender a teoria de cópulas e suas restrições. Além disso, habilidade de ler e buscar artigos foram essenciais, adquirida com projetos de iniciação cientifica na Universidade.

Avaliação do Aluno

A experiência do estágio ajudou a compreender as restrições e considerações que devem ser levadas em conta quando se modela o risco operacional, que tem muito mais dificuldade de ser modelado quando comparado aos outros riscos existentes(mercado, crédito).

Aumentou a minha visão do que é a modelagem estatística aplicada a problemas reais. Além disso, possibilitou a experiência com profissionais extremamente qualificados na área de modelagem de risco operacional.