



E0401

AJUSTE DE PORTFOLIOS COM MÉTODOS DE CÁLCULO DE VALUE-AT-RISK (VAR)

Tiago Fassoni Alves dos Alencar Leite (Bolsista PIBIC/CNPq) e Prof. Dr. Laércio Luis Vendite (Orientador), Instituto de Matemática, Estatística e Computação Científica - IMECC, UNICAMP

Value-at-Risk (VaR) é uma medida da quantidade máxima de dinheiro que pode ser perdida em um investimento em um certo período de tempo, assumindo situações “normais” de mercado. Em suma, é uma tentativa de prever o futuro para tentar evitar prejuízos assombrosos em um portfólio. Neste projeto estudamos a Teoria de Risco e vários métodos de cálculo de VaR. Após isso, estudamos abordagens de ajuste de portfólios utilizando os métodos de cálculo.

Value-at-Risk - Matemática financeira - Teoria de risco