



ANÁLISE DE RISCO EM APLICAÇÕES FINANCEIRAS

MARCO ANTONIO LEONEL CAETANO

Blucher

Resumo de Análise de Risco em Aplicações Financeiras

O que entendemos como risco? Estamos acostumados a relacionar essa palavra ao resultado negativo de eventos, processos ou tarefas. Na realidade, o risco não se refere apenas a resultados negativos, mas também a resultados advindos de retornos positivos sobre diversas atividades, entre elas aquelas ligadas ao mercado financeiro.

Este livro começa descrevendo o risco como uma medida básica de estatística, relacionando diversos comandos do Microsoft Excel com exemplos práticos e reais do mercado financeiro. A descrição da medida de risco ultrapassa os limites das disciplinas tradicionais de administração, economia e finanças, abordando temas que também serão de interesse da matemática, estatística, engenharia e computação, como ferramentas para se entender os movimentos erráticos dos negócios.

O livro tem diversos níveis, começando por temas bem compreendidos por alunos de graduação e se aprofundando nos últimos capítulos para atingir os cursos de pós-graduação. A última parte descreve formulações estocásticas e suas soluções analítica e numérica.

Com dados reais de ações na bolsa de valores, o livro descreve o mercado de opções como parte importante do entendimento do risco nas aplicações financeiras, utilizando para isso exemplos e conceitos do modelo Black-Scholes, operação de call, operação de put, volatilidade histórica e volatilidade implícita.

[Acesse aqui a versão completa deste livro](#)