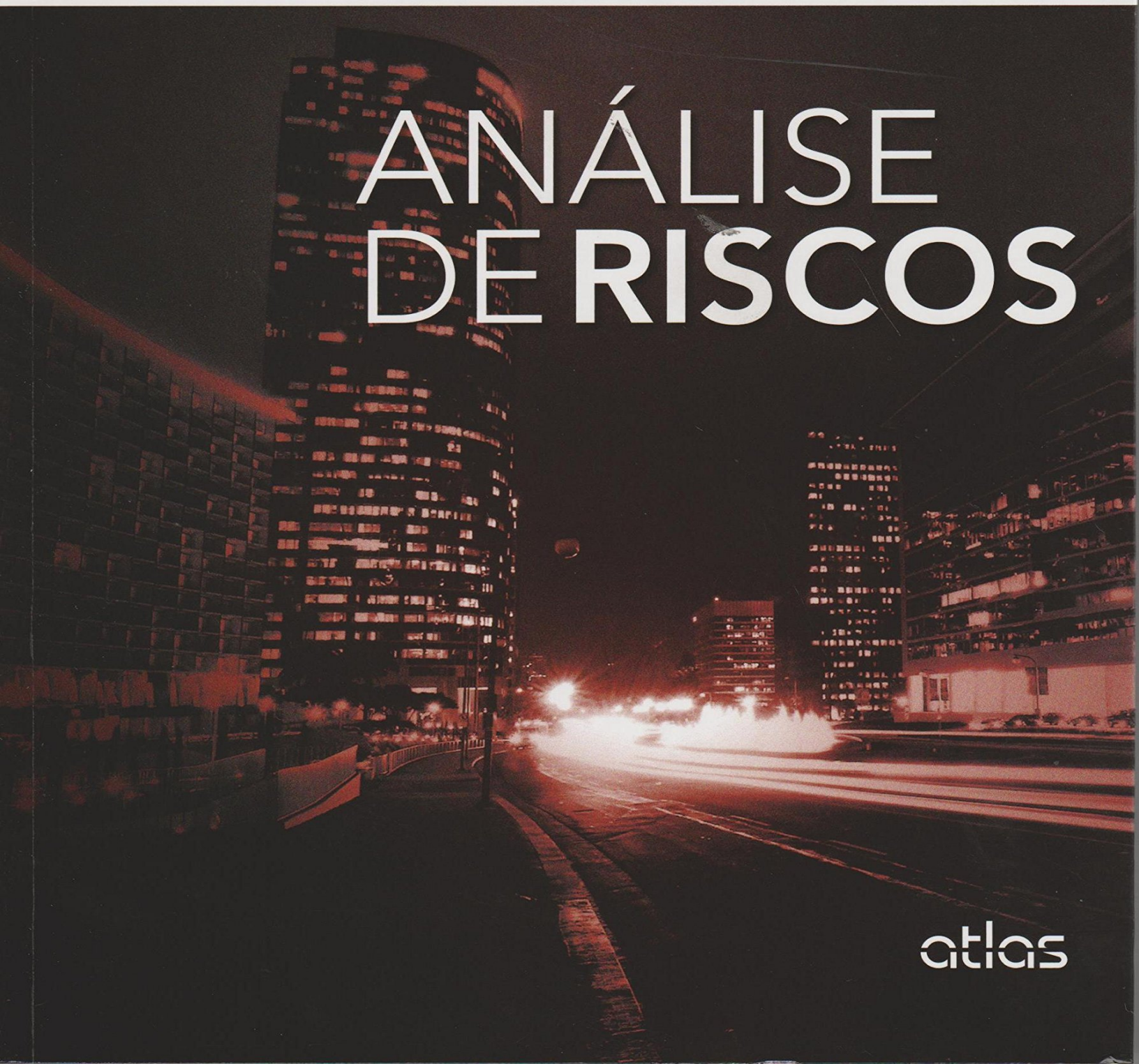
FABIANO GUASTI LIMA

ANÁLISE DE RISCOS



atlas

Resumo de Análise de Riscos

"A grande lição das crises e desastres financeiros ocorridos nos últimos tempos é de que, certamente, RISCO existe. E ele deve ser calculado, mas, principalmente, deve ser administrado. É nesse sentido que análise de riscos surge para proporcionar ao investidor um estudo completo e minucioso para detectar os tipos de riscos existentes.

O diferencial deste livro está na abordagem clara e no uso de uma linguagem bem didática voltada para a mensuração do risco. Fornece informações atualizadas de como entender e analisar o Value at Risk de diferentes produtos do mercado.

Com aplicações práticas ao mercado brasileiro, o livro aborda o estabelecimento de limites de posição em investimentos para análise dos riscos assumidos e avaliação do retorno ajustado ao risco para que possa contribuir para a análise de riscos no mercado.

Inicialmente, o texto apresenta a definição de risco, os tipos de riscos e sua evolução histórica. Faz ainda uma revisão das crises globais mais recentes e dos desastres financeiros que provocaram perdas expressivas em bancos e diversas instituições.

Depois de ilustrar essa parte introdutória, a obra passa a abordar os produtos propriamente ditos, com capítulos específicos sobre a análise de riscos para renda fixa e variável, em projetos de investimentos, de crédito, operacional, até culminar com os modelos avançados de estimação do Value at Risk.

Apresenta ao final de cada capítulo uma série de exercícios com as devidas respostas para complementar o aprendizagem."

Acesse aqui a versão completa deste livro