

RISCOS E CRISES FINANCEIRAS

Ementa

Conceito e componentes dos riscos. Identificação e mitigação de riscos. Metodologias quantitativas e qualitativas para identificação de riscos. Riscos de crédito, de mercado, operacional e integrado e seus componentes. Conceitos estatísticos e de modelagem para riscos. Softwares para modelagem de riscos. Entidades regulatórias de riscos. Regulamentação nacional e internacional sobre riscos. Casos nacionais e internacionais envolvendo eventos de riscos. Cenários econômicos e impacto sobre o retorno e o risco da instituição. Lições das crises internacionais.

Temas

1. Gestão de Riscos
2. Tipos de riscos e seus componentes
3. Estatística para riscos e modelagem
4. Legislação nacional e internacional
5. Crises e cenários econômicos

Referências bibliográficas

- ASSI, M. Gestão de riscos com controles internos. Como vencer os desafios e manter a eficiência dos negócios. 1. ed. São Paulo: Saint Paul Publishing (Brazil), 2012.
- DAMODARAN, A. Gestão estratégica do risco: uma referência para a tomada de riscos empresariais. São Paulo: Grupo A, 2008.
- DA SILVA, J. P. Gestão e análise de risco de crédito. 9. ed. revista e atualizada. São Paulo: Cengage Learning Brasil, 2018.
- FORTUNA, E. Mercado financeiro: produtos e serviços. 22. ed. Rio de Janeiro: Qualitymark, 2020.
- GALVÃO, A. M.; OLIVEIRA, V. D.; F.; et al. Gestão de riscos no mercado financeiro. São Paulo: Saraiva, 2018.
- GIAMBIAGI, F. Derivativos e risco de mercado. São Paulo: Grupo GEN, 2017.
- GIL, A. de L.; ARIMA, C. H.; NAKAMURA, W. T. Gestão: controle interno, risco e auditoria. São Paulo: Saraiva, 2013.
- LIMA, F. G. Análise de riscos. 2. ed. São Paulo: Grupo GEN, 2018.
- OLIVEIRA, A. Método para avaliação de risco operacional em bancos. São Paulo: Blucher, 2017.
- PADOVEZE, C. L.; BERTOLUCCI, R. G. Gerenciamento do risco corporativo em controladoria: enterprise risk management (ERM). 2. ed. São Paulo: Grupo GEN, 2013.
- SANTOS, F. A. de O. Gestão de riscos e estratégias antifraudes. São Paulo: Contentus, 2021.
- SANTOS, J. O. dos. Análise de crédito. Segmento: empresas, pessoas físicas, varejo, agronegócio e pecuária. 6. ed. São Paulo: Grupo GEN, 2015.