

Gestão do Risco na Atividade Bancária e Geração de Valor para o Acionista

1ª Edição

Andrea Resti

Andrea Sironi



Serasa Experian

Resumo de Gestão do Risco na Atividade Bancária e Geração De

A obra apresenta uma estrutura integrada para a medição de risco, a gestão de capital e a criação de valor em bancos. A partir da medição de riscos enfrentados por um banco, definem-se critérios e regras para dar suporte a uma política corporativa orientada à maximização do valor aos acionistas.

Dividido em partes, o livro apresenta os diferentes tipos de risco (incluindo os riscos de taxa de juros, de mercado, de crédito e os operacionais) e como avaliar o montante de capital que eles absorvem por meio de modelos de medição de risco robustos e atualizados; pesquisa os requerimentos de capital regulatório com uma ênfase especial para o Basileia II, suas bases econômicas e implicações gerenciais; além de apresentar modelos e técnicas para calibrar o montante de capital econômico em risco necessário para o banco, para ajustar ao máximo sua composição, alocá-lo para unidades tomadoras de risco, estimar o retorno “justo” esperado pelos acionistas e monitorar o processo de criação de valor, com exercícios, exemplos e teses explicativas.

“Creio que este é o livro de gestão de risco mais abrangente e instrutivo disponível na atualidade.”.

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