

Risco de Mercado | 3,5 ECTS

1. Gestão de Riscos

1.1. Fatores de risco; Tipos de risco

1.2. Capital regulatório

1.2.1. Regulamentação

1.2.2. Requisitos mínimos de capital

2. Value at Risk (VaR)

2.1. Conceitos base

2.2. VaR para distribuições gerais

2.3. VaR para distribuições paramétricas

2.4. VaR incremental

2.5. VaR marginal

3. VaR de instrumentos financeiros

3.1. Ações e taxas de câmbio

3.2. Obrigações: mapping e bucketing

3.3. Derivados lineares: forwards, futuros e swaps

3.4. Derivados não lineares: opções

4. Sistemas de VaR

4.1. Métodos de estimação

4.1.1. Método Delta-Normal

4.1.2. Método histórico

4.1.3. Simulação de Monte Carlo

4.2. Testes de stress

4.3. Análise de cenários

4.4. Eventos extremos e fat tails

4.5. Limitações do VaR