



FICHA TÉCNICA

Título: O cálculo do risco em projetos de investimento

Autor: Eduardo Sá Silva

Editor: Vida Económica

Formato: 15,5 x 23,0 cm

Nº de págs: 64

Preço s/ IVA: € 8,39

Preço c/ IVA: € 8,90

Edição: janeiro de 2014

E-mail: encomendas@vidaeconomica.pt

ISBN: 978-972-788-826-9



O cálculo do risco em projetos de investimento (método probabilístico)

Conheça nesta obra o processo de cálculo do risco baseado em probabilidades.

Os conceitos de variância, covariância, correlação e desvio-padrão são elementos-chave para o entendimento do risco nos projetos de investimentos. Faz-se igualmente referência à simulação Monte Carlo.

O capítulo 6 é reservado para outros critérios alternativos, nomeadamente, o período de recuperação (payback), a análise de sensibilidade, a taxa de atualização ajustada pelo risco e os fluxos equivalentes certos.

É apresentada uma série de exemplos, com a respetiva resolução.

A obra contém ainda figuras, gráficos e mais de 30 quadros.

Estrutura da obra:

- Noção de risco
- Apresentação de um caso adaptado de Securato, 1993
- Situação de independência
- Situação de total dependência
- Situação de alguma dependência

- Comparação das situações
- Modelo desenvolvido por Hiller
- Extensão da fórmula de cálculo do desvio-padrão (risco) para N períodos
- Cálculo da probabilidade de ocorrência
- A utilização da simulação Monte Carlo.
- Outros critérios de cálculo do risco
- Período de recuperação (payback)
- Análise de sensibilidade
- Taxa de atualização ajustada pelo risco
- Fluxos equivalentes certos
- Conclusão

O AUTOR

Eduardo Manuel Lopes de Sá e Silva é doutorado em Ciências Económicas e Empresariais, pela Universidade da Corunha, Espanha, licenciado e mestre pela FEP. É orientador de diversas dissertações de teses de Mestrado e Doutoramento, nas áreas de Contabilidade e Gestão Financeira.