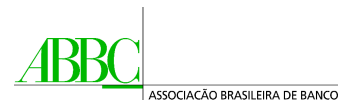


Fórum ABBC

“Tendências do Gerenciamento de Risco de Mercado e a Solução MAPS”



Data: 22 de Junho de 2009
Horário: das 15:00 às 17:00 horas
Local: Sede da ABBC – Av. Paulista, 949 – 6º Andar

A implementação do Acordo da Basileia II está provocando uma série de mudanças na importância e nos papéis desempenhados pelas áreas de Risco de Mercado das instituições financeiras. Os Editais de Audiência Pública 31 e 32, que iniciam o processo de utilização de modelos internos de alocação de capital para risco de mercado, representam mais um passo nesse sentido.

A crise financeira mundial iniciou uma série de discussões sobre a necessidade de maior regulamentação do mercado. O Comitê de Basileia está analisando uma série de propostas de revisão das metodologias de avaliação de riscos e de alocação de capital, a serem publicadas em breve. O Banco Central do Brasil, como novo membro desse Comitê, muito provavelmente não tardará em editar normativos que atualizem as metodologias em vigor, mantendo a política de respostas cada vez mais rápidas de alinhamento às recomendações da Basileia.

Os reflexos dessa crise no Brasil, refletidos nas perdas sofridas por empresas não financeiras de todos os portes, evidenciaram a crescente popularização das operações com derivativos exóticos e a importância da correta avaliação de todos os riscos envolvidos em sua negociação.

Convidamos para evento onde a **MAPS S/A - Soluções e Serviços**, empresa provedora de soluções de gerenciamento de risco de mercado e risco operacional, discutirá esses temas e apresentará exemplos de relatórios regulatórios, análises comparativas de alocação de capital e simulações envolvendo exemplos de derivativos exóticos.

Abertura

Everton P. S. Gonçalves – Assessor Econômico da ABBC

Palestrantes

Afonso de Campos Pinto - Sócio-diretor da MAPS S/A e Professor de Finanças da FGV-SP

Aníbal Sayd Codina Fernández - Sócio-gerente da MAPS S/A com pós-graduação em Administração de Empresas pela COPPEAD/URFRJ

Temas a serem abordados

- Novos papéis das áreas de Risco de Mercado
- Modelos padronizados vs modelos internos de alocação de capital
- Monitoramento efetuado pelo BACEN
- Efeitos da Crise Financeira nos EUA e no Brasil
- Publicações G30/BIS
- Testes de Estresse
- Atuação regulatória do BACEN
- Operações estruturadas - o "subprime" brasileiro
- Derivativos exóticos

Inscrições gratuitas até o dia 18/06/09, através do e-mail eventosabbc@abbc.org.br ou até lotação máxima do Auditório.

Informações: (11) 3288-1688 com as Srtas. Vanessa Felice e/ou Priscila Pontual.

As inscrições só estarão efetivadas, mediante confirmação via e-mail da ABBC.