



CURSO TÉCNICO EM  
**ADMINISTRAÇÃO**



PROFESSOR (A):

**Jorge Augusto  
Costa**



CONTEÚDO:

**Gestão de Risco e  
Incerteza**



DATA:

**01.09.2020**

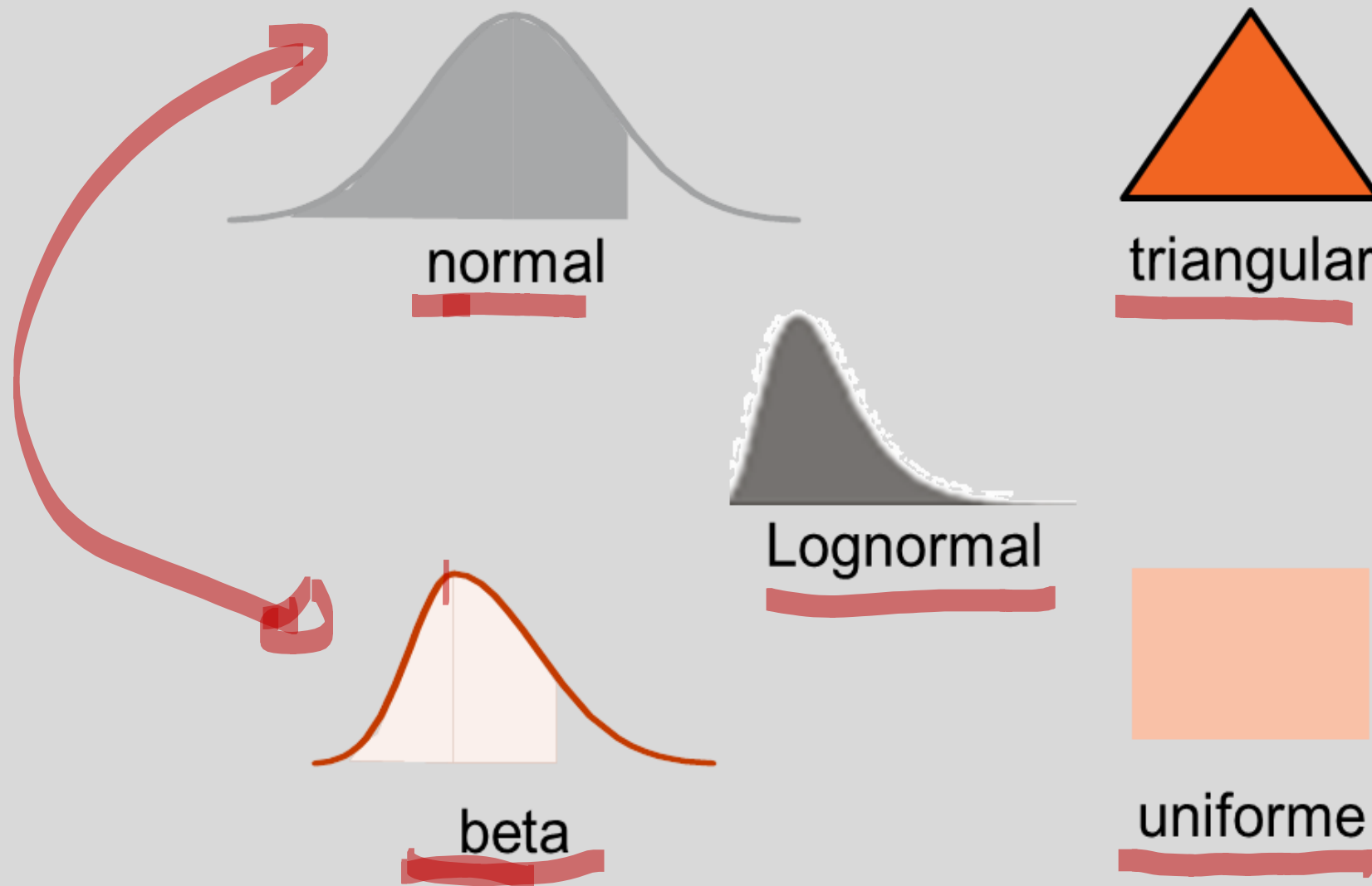


# *Análise Quantitativa de Riscos*



# Análise Quantitativa de Riscos

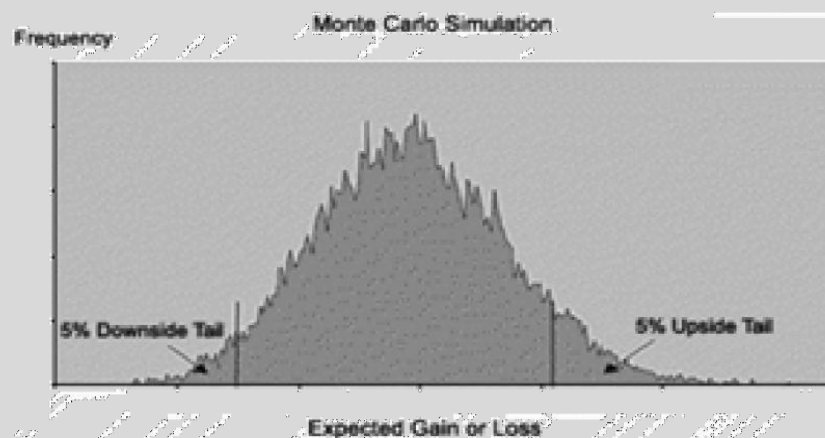
**Identificar a distribuição de probabilidade**



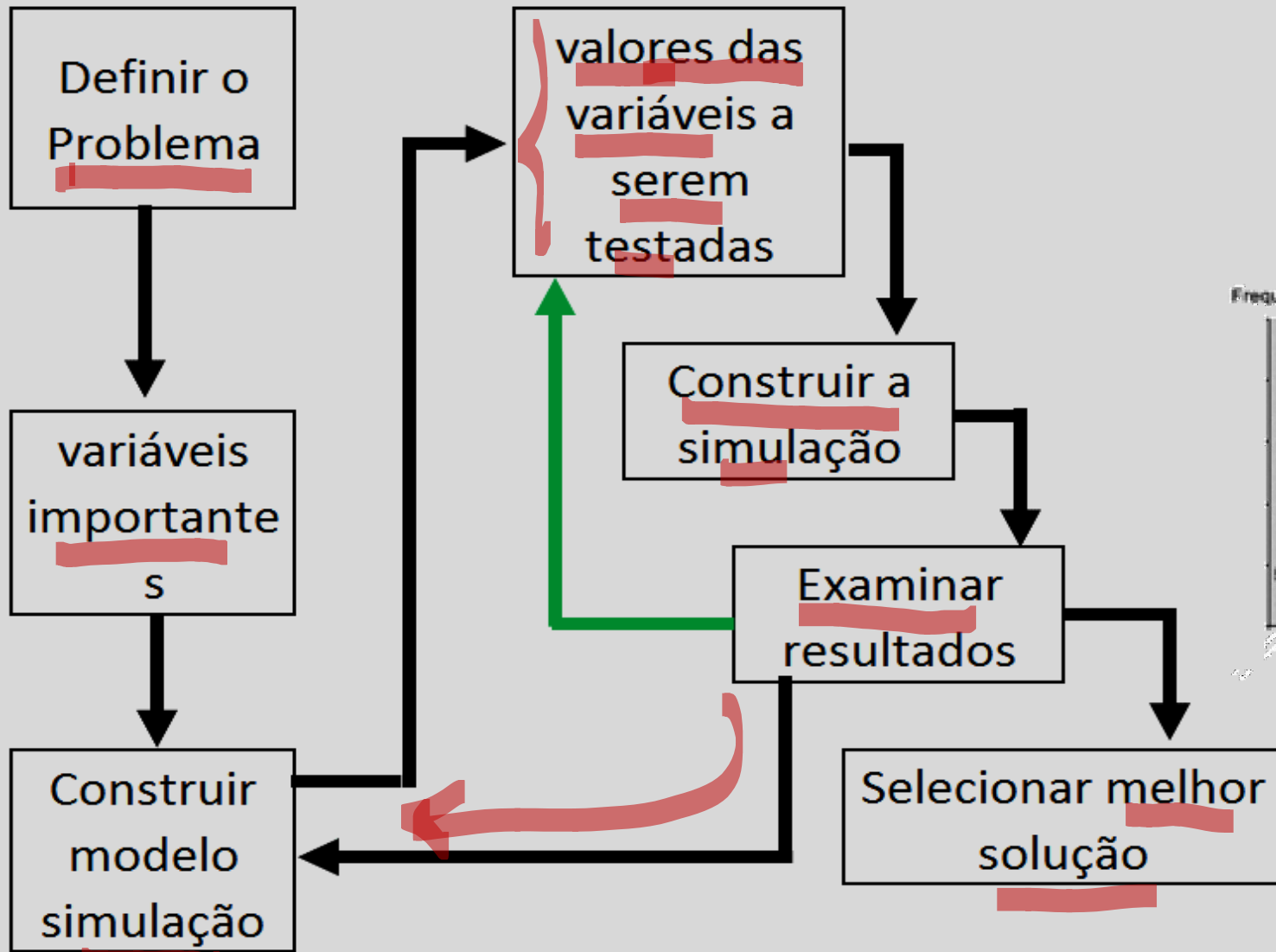
# Análise Quantitativa de Riscos

## Simulação de Monte Carlo

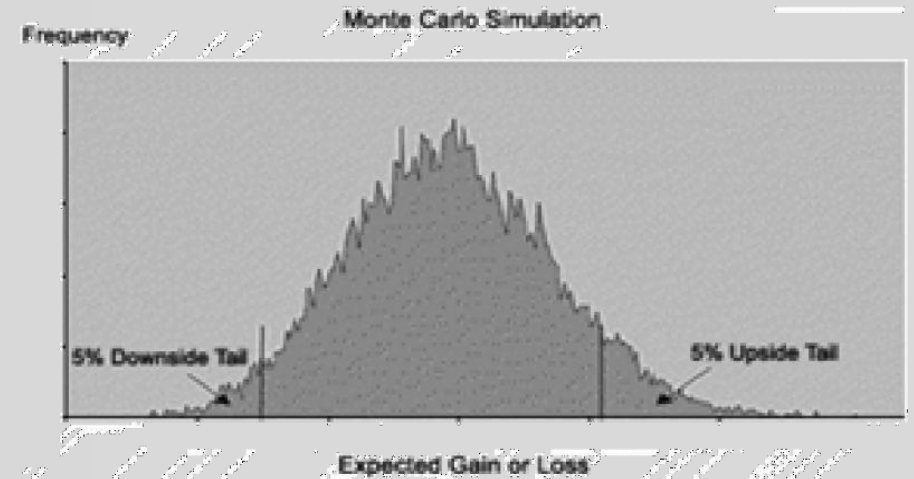
- Simulação de Monte Carlo gera aleatoriamente valores para as variáveis aleatórias construindo vários cenários.
- Para cada variável incerta, definem-se valores possíveis com distribuição de probabilidade mais apropriada.
- Uma simulação calcula vários cenários de um modelo por várias vezes e os valores de amostragem das distribuições de probabilidade.



# Análise Quantitativa de Riscos









## Simulação de Monte Carlo





# Análise Quantitativa de Riscos

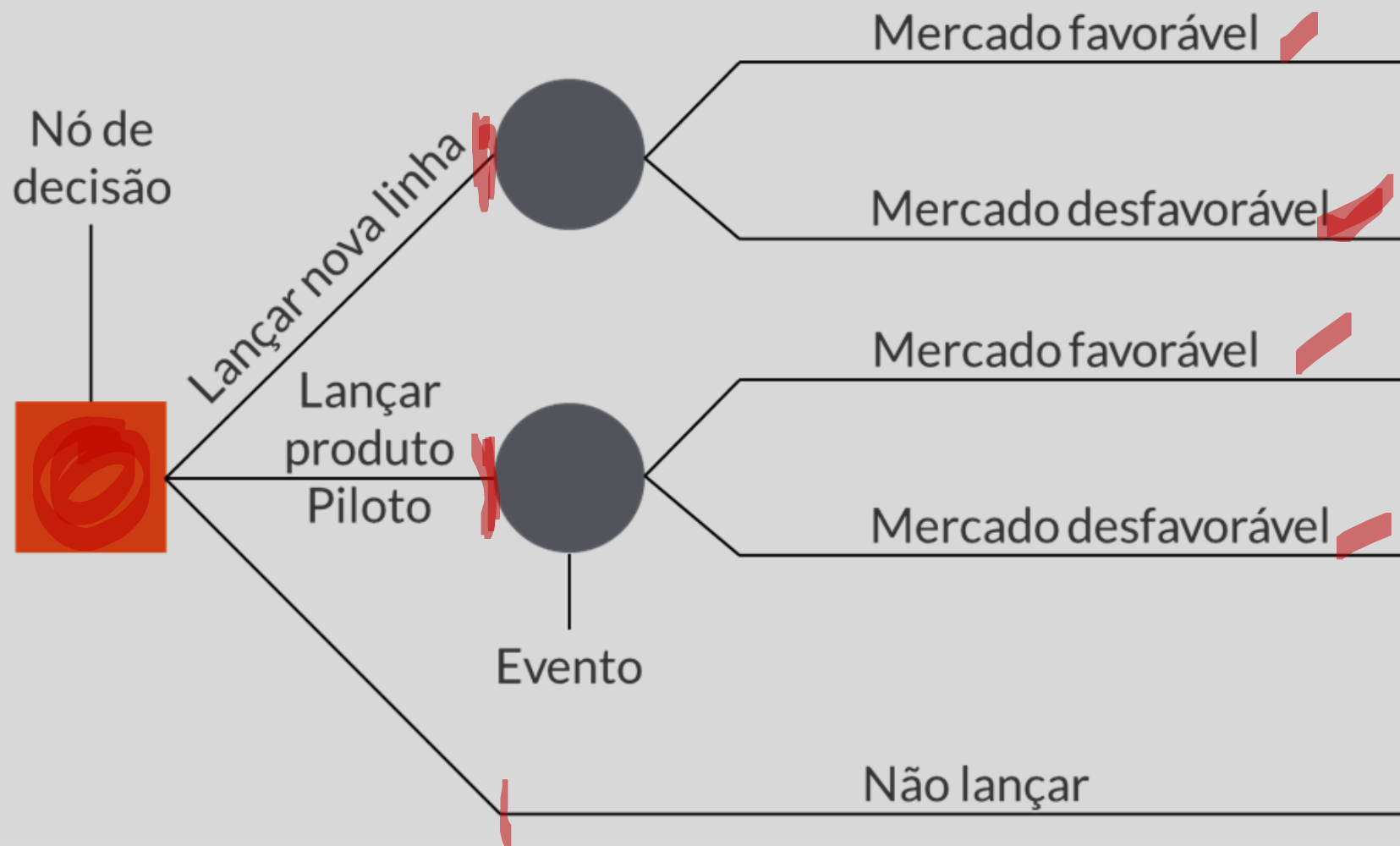
## Arvore de decisão

- Representação gráfica do processo de tomada de decisão. 
- Diagrama que mostra as interações entre decisões e eventos aleatórios associados. 
- Estima os resultados (payoffs) para cada possível combinação de alternativas de decisão e eventos. 
- Valor Monetário Esperado (EMV): soma ponderada de todos os possíveis resultados das alternativas, pela respectiva probabilidade.
- Notação entre nós e ramos:
  -  — Nó de decisão: indica as várias alternativas
  -  — Evento: indica os vários eventos e suas probabilidades
  -  — Resultado



# Análise Quantitativa de Riscos

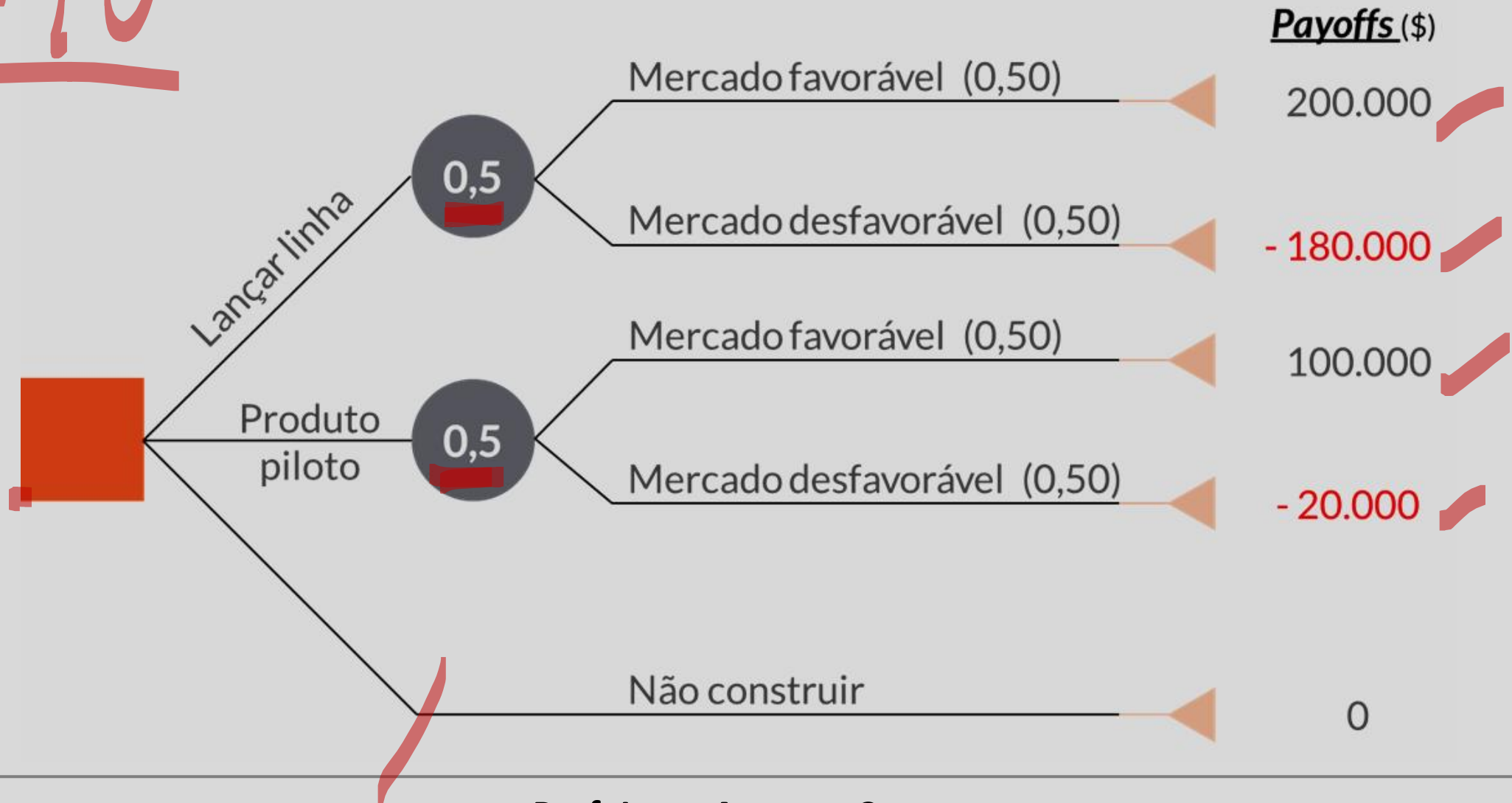
## Arvore de decisão



# Análise Quantitativa de Riscos

## Arvore de decisão

EMV

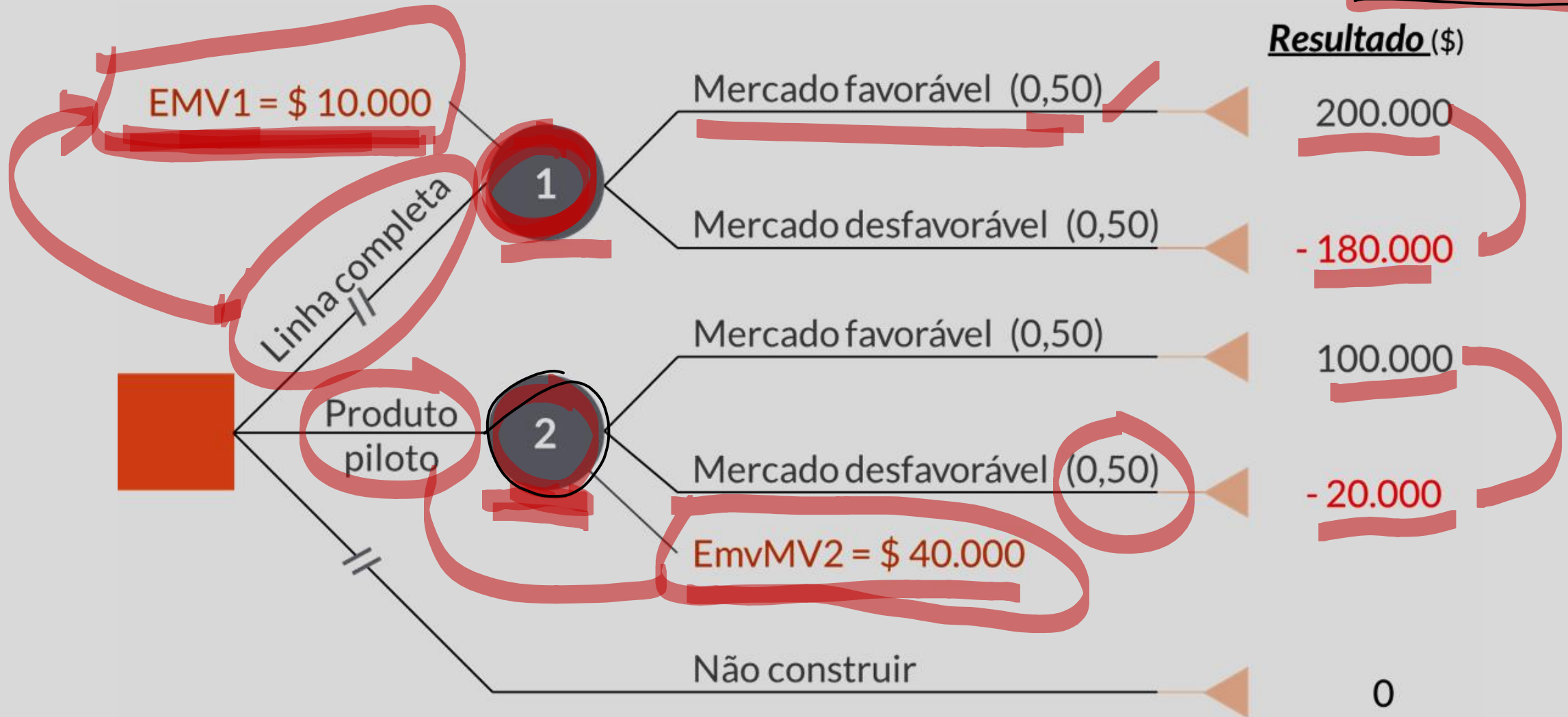




# Análise Quantitativa de Riscos

## Arvore de decisão

Propenso  
Conservador



**Muito obrigado!**  
**Até a próxima.**



**Prof. Jorge Augusto Costa**  
**E-mail: [jct.jac2705@gmail.com](mailto:jct.jac2705@gmail.com)**  
**Celular: 86 9.9851-5570 TIM WhatsApp e Telegram**