

O Banco BBA e a Ascent Financial Technologies adaptaram os instrumentos de análise da FEA para os Mercados Financeiros Brasileiros

São Paulo (Brasil) e Berkeley (USA), 14 de Março de 2002

A Financial Engineering Associates, Inc. (FEA) anunciou hoje que sua empresa parceira no Brasil a Ascent Financial Technologies e o Banco BBA completaram a primeira adaptação da tecnologia FEA value-at-risk (VaR) para os mercados financeiros brasileiros. A Ascent agora oferece os programas para gestão de risco de mercado (FEA's VaR) com assistência direta para os principais instrumentos financeiros brasileiros.

A Ascent customizou o sistema FEA VaR, incluindo o MakeVC[®], VaRworks[®] e VaRlib[™], em forte cooperação com o Banco BBA Creditanstalt S.A. (BBA), o maior banco de atacado independente no Brasil. <http://www.bba.com.br>

“Os principais objetivos do nosso trabalho no BBA eram integrar o FEA's VaRlib com os outros sistemas da empresa, e satisfazer as necessidades do BBA no que diz respeito a uma ferramenta de análise de VaR que incorporasse os fatores de risco específicos para o Brasil”, disse o CEO da Ascent Financial Technologies Sr. Alberto Suen. “O BBA escolheu o FEA's VaR precisamente devido à liderança mundial da tecnologia FEA na área de gestão de risco. Além disso, o BBA foi atraído pela potencialidade e pela flexibilidade do sistema FEA VaR, e também pelo fato de este ser o único sistema licenciado para o uso da patente VaRdelta[®]”.

Enio Bonafé Mendonça de Souza, diretor de gestão de risco do Banco BBA e um dos mais experientes profissionais em gestão de risco no Brasil relatou: “Com a tecnologia FEA VaRdelta, os traders do BBA podem rapidamente escolher operações que otimizem nossas estratégias de hedging, avaliando os impactos de qualquer transação sobre o fluxo de caixa e sobre o risco de mercado do portfólio. O sistema FEA VaR tem um desempenho muito rápido, permitindo estimativas intra-day de VaR, robustos testes de stress, e múltiplas opções de relatórios”.

Suen acrescenta que o sistema FEA VaR customizado pela Ascent irá proporcionar uma vantagem competitiva para as organizações bancárias brasileiras. “Em 2002, com a implementação do Sistema de Pagamentos Brasileiro, o Banco Central irá requerer que os bancos informem sua posição de caixa e suas transações on-line. Empresas que estiverem utilizando a solução FEA VaR terão um sistema de gerenciamento de risco de mercado totalmente integrado, que poderá auxiliar e simplificar necessidades de relatórios de risco de mercado on-line”.

O presidente e cientista chefe da FEA, Dr. Mark Garman, elogia o trabalho da Ascent e do Banco BBA com as tecnologias FEA VaR. “O programa de parcerias da FEA foi projetado para beneficiar empresas como a Ascent. Utilizando a tecnologia de software FEA, a Ascent tem desenvolvido um produto valioso que ganhando força e credibilidade advindos das metodologias de gestão de risco da FEA reconhecidas e provadas internacionalmente”.

Sobre a FEA

Focada nos mercados de commodities, energia e finanças desde 1989, a Financial Engineering Associates, Inc, é renomada no desenvolvimento de softwares que estimam o valor das opções e avaliam o risco de mercado. Movido pela inovação constante, cronogramas dinâmicos para release de novas versões, e um suporte técnico altamente eficiente, a FEA é rotineiramente a líder no mercado de modelos de precificação e nos mercados de ferramentas de gestão de risco para os mais complexos instrumentos financeiros. Entre os mais de 700 clientes institucionais podemos citar empresas de distribuição de energia, companhias listadas entre as Fortune 500, empresas de trading, e empresas financeiras de ponta ao redor do mundo. A FEA permanece na vanguarda da engenharia financeira devido ao seu comprometimento em solucionar as necessidades dos clientes em todo o mundo. Para maiores informações, visite o site <http://www.fea.com/>

Sobre a Ascent Financial Technologies

A Ascent Financial Technologies é uma empresa atuante em Tecnologia da Informação, Consultoria e Treinamento com sede em São Paulo, Brasil. Fundado em 1998 por dois professores da Fundação Getúlio Vargas (FGV), renomada escola de Administração de Empresas brasileira. A Ascent desenvolve soluções tecnológicas inovadoras para instituições financeiras e companhias participantes do mercado brasileiro. Para maiores informações, visite o site <http://www.ascent.com.br/>