

Histórico do Gerenciamento de Riscos

Baseado no livro de Peter Bernstein – O Desafio aos Deuses

Ricardo Viana Vargas, MSc, IPMA-B, PMP
ricardo.vargas@macrosolutions.com.br

Ricardo Viana Vargas, MSc, IPMA-B, PMP

Ricardo Vargas é especialista em gerenciamento de projetos, portfólio e riscos. Foi, nos últimos 15 anos, responsável por mais de **80 projetos de grande porte** em diversos países, nas áreas de petróleo, energia, infraestrutura, telecomunicações, informática e finanças, com um portfólio de investimentos gerenciado superior a 18 bilhões de dólares.

Foi o primeiro voluntário latino-americano a ser eleito para exercer a função de presidente do conselho diretor (Chairman) do **Project Management Institute (PMI)**, maior organização do mundo voltada para a administração de projetos, com cerca de 500 mil membros e profissionais certificados em 175 países.

Ricardo Vargas escreveu **dez livros** sobre gerenciamento de projetos, publicados em português e inglês, com mais de 200 mil exemplares vendidos mundialmente. Recebeu em 2005 o prêmio PMI Distinguished Award pela sua contribuição para o desenvolvimento do gerenciamento de projetos e o PMI Professional Development Product of the Year pelo workshop PMDome®, considerado a melhor solução do mundo para o ensino do gerenciamento de projetos.

É professor de gerenciamento de projetos em diversos cursos de MBA, participando do conselho editorial de revistas especializadas no Brasil e nos Estados Unidos. Vargas é revisor reconhecido da mais importante referência no mundo sobre gerenciamento de projetos, o **PMBOK Guide**. Foi também chair da tradução oficial do PMBOK para o português.

Engenheiro químico e mestre em Engenharia de Produção pela UFMG, Ricardo Vargas tem também o Master Certificate in Project Management pela George Washington University, além de ser certificado pelo PMI como Project Management Professional (PMP) e pela International Project Management Association como IPMA-B. Participou do programa de negociações para executivos da **Harvard Law School**.

Durante onze anos, a partir de 1995, desenvolveu em conjunto com dois sócios um dos mais sólidos negócios de tecnologia, gerenciamento de projetos e terceirização do mercado brasileiro, que contava com **4,000 colaboradores** e gerava uma receita anual de 50 milhões de dólares em 2006, quando Ricardo Vargas vendeu sua participação para se dedicar integralmente à internacionalização de seus trabalhos em gerenciamento de projetos.

É membro da Association for Advancement of Cost Engineering (**AACE**), da American Management Association (**AMA**), da International Project Management Association (**IPMA**), do Institute for Global Ethics e da Professional Risk Management International Association (**PRMIA**).



Aspectos Históricos

O passado remoto foi repleto de cientistas brilhantes, de matemáticos, de inventores, de tecnólogos e de filósofos políticos.

- Centenas de anos antes do nascimento de Cristo, os céus haviam sido mapeados,
- a grande biblioteca de Alexandria fora construída e a geometria de Euclides era ensinada,
- e a demanda por inovações tecnológicas para fins bélicos era tão insaciável quanto atualmente.



Aspectos Históricos

A idéia revolucionária que define a fronteira entre os tempos modernos e o passado é o **domínio do risco**:

- a noção de que o futuro é mais do que um capricho dos deuses e de que homens e mulheres não são passivos ante a natureza.
- Até que os seres humanos descobrissem como transpor essa fronteira, o futuro era um espelho do passado ou um obscuro oráculo que detinha o monopólio sobre o conhecimento dos eventos previstos.



O Desafio aos Deuses...

Desafio aos Deuses

A Fascinante História do Risco

A obra narra a história de um grupo de pensadores cuja visão notável revelou como **pôr o futuro a serviço do presente**.

Ao mostrar ao mundo como compreender o risco, medi-lo e avaliar suas conseqüências, eles converteram o **ato de correr riscos** em um dos **principais catalisadores** que impellem a sociedade ocidental moderna.

Algumas Conclusões: O Desafio aos Deuses...

Sem o seguro em suas muitas variedades,

- a morte do pai de família reduziria os filhos jovens à penúria ou à caridade;
- a assistência médica seria negada a um número ainda maior de pessoas.

Se os agricultores não pudessem vender suas safras antes da colheita, produziram muito menos alimentos.

A capacidade de administrar o risco é o elemento-chave da **energia que impulsiona o sistema econômico.**

Como tudo começou...

A palavra "**risco**" deriva do italiano antigo *risicare*, que significa "ousar".

Nesse sentido, o risco é uma opção, e não um destino.

É das ações que ousamos tomar que depende nosso grau de liberdade de opção,

OUSAR AINDA É A MELHOR MANEIRA DE VENCER

Como tudo começou...

O estudo sério do risco começou no **Renascimento**, quando as pessoas se libertaram das restrições do passado e desafiaram abertamente as crenças consagradas.

Foi uma época em que grande parte do mundo seria descoberta e seus recursos, explorados.

Uma época de turbulência religiosa, de capitalismo nascente e de uma abordagem vigorosa da ciência e do futuro.

Como tudo começou...

1654 – Enigma de Méré

- O cavaleiro de Méré, nobre francês com gosto pelo jogo, desafiou o famoso matemático Blaise Pascal a decifrar um enigma proposto por Paccioli 200 anos antes.
- *Como dividir as apostas de um jogo de azar, que foi interrompido quando um deles estava vencendo, entre os dois jogadores?*
- Pascal pediu ajuda a Pierre de Fermat, e o resultado de sua colaboração foi pura **dinamite intelectual**.
- O que poderia parecer uma versão do século XVII do jogo da Busca Trivial levou à descoberta da **teoria das probabilidades**, o núcleo matemático do conceito de risco.

Como tudo começou...

A solução do enigma de Paccioli permitiu que, pela primeira vez, as pessoas tomassem decisões e previssem o futuro com **ajuda dos números**.

Naquela época, os indivíduos conseguiam tomar decisões, defender seus interesses e praticar o comércio, mas sem uma compreensão real do **risco ou da natureza da tomada de decisões**.

Com o tempo, os matemáticos transformaram a teoria das probabilidades em um **instrumento poderoso** de organização, interpretação e aplicação das informações.

Como tudo começou...

Século XVIII

- Os matemáticos competiam entre si na invenção de **tabelas de expectativas de vida**
- Seguros marítimos haviam emergido como um florescente e sofisticado negócio em Londres.
- Gottfried von Leibniz afirmou: "**a natureza estabeleceu padrões que dão origem ao retorno dos eventos, mas apenas na maior parte dos casos**", levando, assim, Bernoulli a inventar a Lei dos Grandes Números e a amostragem estatística.

Como tudo começou...

Abraham de Moivre expôs a estrutura da **distribuição normal** - também conhecida como curva em sino – e descobriu o conceito de **desvio padrão**.

Constituíram a base da **Lei das Médias**.



Como tudo começou...

Daniel Bernoulli definiu, pela primeira vez, o processo sistemático pelo qual a maioria das pessoas realiza escolhas e chega a decisões.

Propôs a idéia de que a satisfação resultante de qualquer pequeno aumento de riqueza "será **inversamente proporcional à quantidade de bens anteriormente possuídos**".

Com essa afirmação, Bernoulli explicou

- por que o rei Midas era um homem infeliz,
- por que as pessoas tendem a ser avessas ao risco e
- por que os preços têm de cair para que os clientes sejam persuadidos a comprar mais.

Como tudo começou...

Thomas Bayes

- Deu um impressionante avanço em estatística ao demonstrar **como tomar melhores decisões mesclando matematicamente as novas informações com as informações velhas.**
- O teorema de Bayes enfoca as ocasiões freqüentes em que temos julgamentos intuitivos seguros sobre a probabilidade de algum evento e queremos entender como alterá-los com o desenrolar dos eventos reais.

Como tudo começou...

1952

- **Harry Markowitz** demonstrou matematicamente por que colocar todos os ovos na mesma cesta é uma estratégia inaceitavelmente arriscada e por que a **diversificação** é o melhor negócio.



R I C A R D O
V A R G A S

Visite

www.ricardo-vargas.com

**Para acessar outras apresentações,
podcasts, videos e conteúdo
técnico sobre gerenciamento de
projetos, riscos e portfólio.**