



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

Programa da Unidade Curricular
OPÇÃO: GESTÃO DE RISCO

Ano Lectivo 2019/2020

1. Unidade Orgânica

Faculdade de Ciências da Economia e da Empresa (2º Ciclo)

2. Curso

Mestrado em Gestão

3. Ciclo de Estudos

2º

4. Unidade Curricular

OPÇÃO: GESTÃO DE RISCO (70208)

5. Área Científica

6. Ano curricular

1º

7. Tipo de Unidade Curricular / Semestre

2º Semestre



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

8. Tipo de aula e carga horária (tempo de trabalho)

Aulas Teóricas:	
Aulas Práticas:	
Aulas Teórico-práticas:	15,00
Orientação Tutorial:	20,00

9. Créditos

7,50

10. Coordenador da Área Científica

11. Regente

Prof. Doutor MIGUEL ALEXANDRE TEIXEIRA COELHO

12. Assistentes

13. Língua de ensino

Português

14. Objectivos Gerais

A unidade curricular foi concebida com o objetivo de proporcionar ao estudante as competências necessárias para identificar, analisar, quantificar e gerir os riscos com o objetivo de criar valor económico para as empresas e para a sociedade.

Dominar os conceitos subjacentes à gestão de riscos no atual ambiente de mercado dinâmico e competitivo, permitirá aos alunos obter uma visão holística da gestão de riscos.

15. Objectivos Específicos

Os objectivos específicos da unidade curricular são os seguintes:

1. Identificação e caracterização dos principais riscos financeiros.
2. Medição dos principais riscos financeiros.
3. Definição e implementação de estratégias de cobertura dos riscos financeiros.

16. Competências a adquirir

- Capacidade para avaliar a importância dos mercados financeiros na economia mundial.
- Capacidade para caracterizar genericamente o enquadramento regulamentar no âmbito dos mercados financeiros.
- Capacidade para identificar e caracterizar os principais riscos financeiros.
- Capacidade para quantificar os principais riscos financeiros.
- Capacidade para definir e implementar estratégias de cobertura dos riscos financeiros.



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

17. Metodologia de ensino

O método combina a exposição teórica (saber-saber) com a resolução de casos práticos e exercícios de simulação (saber - fazer), cobrindo o enquadramento, os conceitos e os modelos inerentes a cada uma das matérias a lecionar. Procura-se ainda discutir a conciliação entre conhecimentos teóricos e conhecimentos práticos em contextos reais, assegurando desta forma uma perspetiva phronetica(sabedoria)do tema.

18. Conteúdos Programáticos

1.Introdução

1.1.Mercados Financeiros Internacionais: Enquadramento.

1.2 Instrumentos Financeiros: Breve Revisão.

2. Princípios Básicos na Gestão do Risco

2.1 Processo de Decisão em Contexto de Incerteza: Uma Aplicação à Gestão de Risco

2.2.Relação Rendibilidade-Risco.

2.3.Enquadramento Regulamentar dos mercados financeiros.

3. Identificação, Caracterização e Medição dos Principais Riscos Financeiros

3.1.Introdução.

3.2. Risco Liquidez.

3.3. Risco de Mercado.

3.4. Risco de Crédito.

4. Gestão dos Principais Riscos Financeiros

19. Métodos de Avaliação

A avaliação contínua assenta em 2 elementos distintos, a saber:

- Participação nas aulas tutoriais.
- Testes.

20. Recursos Didáticos

Power Point

Excel

Word

Internet

21. Palavras Chave

Mercados Financeiros

Gestão do Risco



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

23. Bibliografia Principal

Autor(es): Coelho, M. e Sainhas, R.
Título: Mercados - São mesmo os grandes culpados das crises?
Edição: 1ª Ano: 2015
Local: Lisboa
Editora: Bnomics

Autor(es): Jorion, Philippe
Título: Financial Risk Manager Handbook
Edição: 2ª Ano: 2003
Local: New Jersey
Editora: John Wiley & Sons

Autor(es): Hull, J
Título: Options, Futures and Others Derivatives
Edição: 6ª Ano: 2005
Local: London
Editora: Prentice-Hall

24. Bibliografia Complementar

Autor(es): Bennings
Título: Financial Modeling
Edição: 2ª Ano: 2000
Local: London
Editora: MIT Press

Autor(es): Elton, E e Gruber, J.
Título: Modern Portfolio Theory and Investment Analysis
Edição: 6ª Ano: 2002
Local: London
Editora: J. Wiley & Sons



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

Ficha técnica MIP	
Título	Programa da unidade curricular 'OPÇÃO: GESTÃO DE RISCO': Ano Lectivo 2019/2020
Autor	Prof. Doutor MIGUEL ALEXANDRE TEIXEIRA COELHO
Classificação	-
Descritores	-
Colaborador(es)	-
Data/Hora	17-02-2020 11:38:00
Formato de dados	Texto, PDF
Estatuto de utilização	Acesso público
Relação	Versão 1,0
(c) Universidade Lusíada de Lisboa, 2020	