UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

Programa da Unidade Curricular
OPÇÃO: GESTÃO DE RISCO

Ano Lectivo 2021/2022

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

FUNDAÇÃO MINERVA CULTURA - ENSINO E INVESTIGAÇÃO CIENTÍFICA

Rua da Junqueira, 188 a 198 - 1349-001 LISBOA - Telefone 213 611 500 - Fax 213 638 307 - e-mail: info@lis.ulusiada.pt - http://www.lis.ulusiada.pt

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.

FUNDAÇÃO MINERVA CULTURA - ENSINO E INVESTIGAÇÃO CIENTÍFICA

Rua da Junqueira, 188 a 198 - 1349-001 LISBOA - Telefone 213 611 500 - Fax 213 638 307 - e-mail: info@lis.ulusiada.pt - http://www.lis.ulusiada.pt

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.
1.3.Enquadramento Regulamentar dos mercados financeiros.

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.

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
4.1.Introdução.
4.2. Gestão do Risco Liquidez.
4.3. Gestão do Risco de Mercado.
4.4. Gestão do Risco de Crédito.

19. Métodos de Avaliação

A avaliação contínua
- Participação nas aulas tutoriais.
- 2 testes de avaliação.

20. Recursos Didácticos

Power Point
Excel
Word
Internet

21. Palavras Chave

Mercados Financeiros
Gestão do Risco

FUNDAÇÃO MINERVA CULTURA - ENSINO E INVESTIGAÇÃO CIENTÍFICA

Rua da Junqueira, 188 a 198 - 1349-001 LISBOA - Telefone 213 611 500 - Fax 213 638 307 - e-mail: info@lis.ulusiada.pt - http://www.lis.ulusiada.pt

23. Bibliografia Principal

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

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

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

24. Bibliografia Complementar

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

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

FUNDAÇÃO MINERVA CULTURA - ENSINO E INVESTIGAÇÃO CIENTÍFICA

Rua da Junqueira, 188 a 198 - 1349-001 LISBOA - Telefone 213 611 500 - Fax 213 638 307 - e-mail: info@lis.ulusiada.pt - http://www.lis.ulusiada.pt

UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

Ficha técnica MIP	
Título	Programa da unidade curricular 'OPÇÃO: GESTÃO DE RISCO': Ano Lectivo 2021/2022
Autor	Prof. Doutor MIGUEL ALEXANDRE TEIXEIRA COELHO
Classificação	-
Descritores	-
Colaborador(es)	-
Data/Hora	13-09-2021 23:21:00
Formato de dados	Texto, PDF
Estatuto de utilização	Acesso público
Relação	Versão 1,0

(c) Universidade Lusíada de Lisboa, 2021

FUNDAÇÃO MINERVA CULTURA - ENSINO E INVESTIGAÇÃO CIENTÍFICA

Rua da Junqueira, 188 a 198 - 1349-001 LISBOA - Telefone 213 611 500 - Fax 213 638 307 - e-mail: info@lis.ulusiada.pt - http://www.lis.ulusiada.pt