



UNIVERSIDADE LUSÍADA
LISBOA

Programa da Unidade Curricular
OPÇÃO: GESTÃO DE RISCO

Ano Lectivo 2024/2025

1. Unidade Orgânica

Faculdade de Ciências da Economia e da Empresa

2. Curso

MESTRADO EM GESTÃO

3. Ciclo

2º

4. Unidade Curricular

OPÇÃO: GESTÃO DE RISCO (70208)

5. Área Científica

6. Ano Curricular

1º

7. Tipo de Unidade Curricular / Semestre

1º Semestre



UNIVERSIDADE LUSÍADA
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 ECTS

7,50

10. Coordenador da Área Científica

11. Regente

Prof. Doutor MIGUEL ALEXANDRE TEIXEIRA COELHO

12. Assistentes

13. Língua de Ensino

Português

14. Objetivos 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. Objetivos 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
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.

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: 2 testes de avaliação.

20. Recursos Didáticos

Power Point

Excel

Word

Internet

21. Objetivos de Sustentabilidade

A unidade curricular procura sensibilizar os alunos para a necessidade de assegurar princípios financeiros sustentáveis na gestão dos riscos. Ou seja, a gestão de riscos entendida como instrumento para apoiar o crescimento económico, reduzindo, simultaneamente, as pressões sobre o ambiente e tendo em conta os aspetos sociais e de governação



UNIVERSIDADE LUSÍADA
LISBOA

22. Palavras Chave

Mercados Financeiros
Gestão do Risco

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
LISBOA

Ficha técnica MIP / MIP Datasheet	
Título / Title	Programa da unidade curricular 'OPÇÃO: GESTÃO DE RISCO': Ano Lectivo 2024/2025
Autor / Author	Prof. Doutor MIGUEL ALEXANDRE TEIXEIRA COELHO
Classificação / Classification	-
Descritores / Descriptors	-
Colaborador(es) / Colaborator(s)	-
Data Hora / Date Time	01-08-2024 20:10:00
Formato de dados / Data Format	Texto / Text, PDF
Estatuto de utilização / Usage	Acesso público / Public Access
Relação / Relation	Versão 1,0
(c) Universidade Lusíada, 2024	