UNIVERSIDADE LUSÍADA
LISBOA

Programa da Unidade Curricular
OPÇÃO: GESTÃO DE RISCO

Ano Lectivo 2025/2026

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

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 - https://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 ECTS

7,50

10. Coordenador da Área Cientifica

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.

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 - https://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. Conceitos básicos: risco, incerteza, volatilidade.
1.2. Tipologias de risco: estratégico, operacional, financeiro, reputacional, ESG.
1.3. Relação rendibilidade/risco.
1.4. Processo de decisão em contexto de incerteza.

2. Sistema de Gestão de Riscos
2.1 Modelo de Governo
2.2 Cultura e Apetite ao Risco
2.3 Etapas do Processo de Gestão de Riscos

3. Identificação, Caracterização, Medição e gestão dos Principais Riscos
3.1.Introdução.
3.2. Risco Liquidez.
3.3. Risco de Mercado.
3.4. Risco de Crédito.
3.5. Outros Riscos

19. Métodos de Avaliação

Avaliação contínua: 1 teste de avaliação + trabalho de grupo

20. Recursos Didáticos

Power Point
Excel
Word
Internet

21. Objetivos de Sustentabilidade

A UC tem como objetivo integrar princípios de sustentabilidade na gestão de risco, capacitando os estudantes a incorporar fatores ESG e promover a criação de valor sustentável a longo prazo. Neste contexto, e no âmbito dos ODS, teremos os seguintes objetivos: ODS4 (desenvolvimento de competências avançadas em gestão de risco); ODS9 (uso de instrumentos de gestão de risco no suporte à inovação e resiliência); ODS 12 (integração de fatores ESG na gestão de risco); ODS 13 (avaliação e mitigação de

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 - https://www.lis.ulusiada.pt

22. Palavras Chave

Gestão do Riscos
Mercados Financeiros
Sustentabilidade de Longo Prazo

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 - https://www.lis.ulusiada.pt

23. Bibliografia Principal

Autor(es): Edwin J. Elton, Martin J. Gruber, Stephen J. Brown e William N. Goetzmann
Título: Modern Portfolio Theory and Investment Analysis
Edição: 9ª Ano: 2017
Local: London
Editora: J. Wiley & Sons
Codigo ISBN: 978-1119427292

Autor(es): John C. Hull
Título: Risk Management and Financial Institutions
Edição: 2ª Ano: 2023
Local:
Editora: John Wiley & Sons
Codigo ISBN: 978-1119932482

Autor(es): Hull, J
Título: Options, Futures and Others Derivatives
Edição: 11ª Ano: 2021
Local: London
Editora: Prentice-Hall
Codigo ISBN: 978-1292410654

24. Bibliografia Complementar

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

Autor(es): Jorion, Philippe
Título: Financial Risk Manager Handbook
Edição: 6ª Ano: 2003
Local:
Editora: John Wiley
Codigo ISBN:

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 - https://www.lis.ulusiada.pt

UNIVERSIDADE LUSÍADA
LISBOA

Ficha técnica MIP / MIP Datasheet	
Título / Title	Programa da unidade curricular 'OPÇÃO: GESTÃO DE RISCO': Ano Lectivo 2025/2026
Autor / Author	Prof. Doutor MIGUEL ALEXANDRE TEIXEIRA COELHO
Classificação / Classification	-
Descritores / Descriptors	-
Colaborador(es) / Colaborator(s)	-
Data Hora / Date Time	16-10-2025 14:02:00
Formato de dados / Data Format	Texto / Text, PDF
Estatuto de utilização / Usage	Acesso público / Public Access
Relação / Relation	Versão 2,0

(c) Universidade Lusíada, 2025

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 - https://www.lis.ulusiada.pt