

Unidade Curricular	Optativa II - Análise e Gestão do Risco		Área Científica	Finanças	
Mestrado em	Contabilidade e Finanças		Escola	Escola Superior de Tecnologia e Gestão de Bragança	
Ano Letivo	2018/2019	Ano Curricular	1	Nível	2-1
Tipo	Semestral	Semestre	2	Créditos ECTS	6.0
Código	6395-515-1204-01-18				
Horas totais de trabalho	162	Horas de Contacto	T -	TP 36	PL -
			TC -	S 3	E -
			OT 9	O -	

T - Ensino Teórico; TP - Teórico Prático; PL - Prático e Laboratorial; TC - Trabalho de Campo; S - Seminário; E - Estágio; OT - Orientação Tutoria; O - Outra

Nome(s) do(s) docente(s) Ana Paula Carvalho do Monte

Resultados da aprendizagem e competências

No fim da unidade curricular o aluno deve ser capaz de:

1. Identificar, quantificar e gerir, de forma integrada, o risco em instituições financeiras (Bancos e Seguradoras) e não financeiras, com particular ênfase em risco operacional, de mercado e de crédito;
2. Aplicar metodologias de quantificação do risco como o VaR e outros;
3. Delinear estratégias de cobertura de risco (de taxas de juro) com recurso a derivados.

Pré-requisitos

Não aplicável

Conteúdo da unidade curricular

Enquadramento: tipos e fatores de risco (risco financeiro e risco operacional) e o Acordo de Basileia. Análise e medição do risco de mercado e operacional. Análise e medição do risco de crédito. Gestão do risco de taxa de juro.

Conteúdo da unidade curricular (versão detalhada)

1. Introdução
2. O Acordo de Basileia e suas implicações na gestão do risco no setor bancário e segurador
3. Análise e medição do risco de mercado e operacional
4. Análise e medição do risco de crédito
5. Gestão do risco de taxa de juro

Bibliografia recomendada

1. Bessis, J. (2015). Risk Management in Banking, 4th Edition, Chichester, West Sussex (UK): John Wiley and Sons Editors.
2. Jorion, P. (2009). Financial Risk Manager Handbook, 5th Edition, Chichester, West Sussex (UK): John Wiley and Sons Editors (Finance).
3. Lando, D. (2004). Credit Risk Modeling: Theory and Applications, Princeton University Press.
4. Saunders, A. & Allen, L. (2002). Credit Risk Measurement: New Approaches to Value at Risk and Other Paradigms, 2nd edition, Chichester, West Sussex (UK): John Wiley and Sons Editors.
5. Saunders, A. & Cornett, M. M. (2017). Financial Institutions Management: A Risk Management Approach, 9th international edition, McGraw-Hill editions.

Métodos de ensino e de aprendizagem

Aulas teórico-práticas com recurso a meios audiovisuais que se baseiam no “aprender fazendo”, envolvendo a participação ativa dos alunos através de intervenções, trabalhos individual e de grupo e a resolução de exercícios e casos. Apresenta-se e discute-se situações concretas de modo a permitir a aplicação da teoria na prática em contexto real e consolidar resultados de aprendizagem.

Alternativas de avaliação

1. Alternativa A - (Ordinário, Trabalhador) (Final, Recurso)
 - Temas de Desenvolvimento - 30% (Trabalho, em grupo de no máximo 4 elementos, com apresentação e discussão em sala de aula.)
 - Trabalhos Práticos - 30% (A elaborar dentro da sala de aula e /ou nas horas não presenciais individual ou em grupo)
 - Discussão de Trabalhos - 20% (Preparação e discussão de temáticas em sala aula. Participação mínima de 60% das aulas.)
 - Apresentações - 20% (Apresentações orais e escritas dos trabalhos desenvolvidos. Auto e heteroavaliação pelos pares.)
2. Alternativa B - (Ordinário, Trabalhador) (Final, Recurso)
 - Temas de Desenvolvimento - 30% (Trabalho, em grupo de no máximo 4 elementos, com apresentação e discussão em sala de aula)
 - Trabalhos Práticos - 30% (A elaborar dentro da sala de aula e /ou nas horas não presenciais individual ou em grupo)
 - Exame Final Escrito - 40% (Sobre todos os conteúdos programáticos da UC (Todos os alunos podem escolher esta alternativa))
3. Alternativa C - (Ordinário, Trabalhador) (Recurso, Especial)
 - Exame Final Escrito - 100% (todos os alunos podem escolher esta alternativa (mesmo que na época normal tenham feito outra))

Língua em que é ministrada

1. Português
2. Inglês

Validação Eletrónica

Ana Paula Carvalho do Monte	António Borges Fernandes	Nuno Adriano Baptista Ribeiro
18-03-2019	22-03-2019	13-05-2019