

1.
Apresentação geral

2.
Objetivo geral

3.
Programa resumido

4.
Bibliografia principal

1.

Curso: Finanças Empresariais

Área/ Subárea: Finanças e Economia / Finanças

Semestre: 6º semestre

Carga horária: 3,0 horas

ECTS: 4

2.

Criar capacidades nos seguintes domínios: gestão dos riscos de mercado, de crédito, operacional e de taxa de juro, mediante a utilização de derivados e introdução às metodologias de avaliação de risco baseadas no *Value at Risk* (VaR).

3.

1. Introdução aos Riscos Financeiros

2. Risco Operacional

3. Risco de Mercado

4. Risco de Taxa de Juro

5. Risco de Crédito

6. Gestão de Riscos Financeiros em Empresas não Financeiras

4.

Jorion, Philippe, Financial Risk Manager Handbook, 6th Edition, 2011, Wiley Finance Hull, John, Risk Management and Financial Institutions, 3rd Edition, 2012, Wiley Finance Saunders, Anthony, Financial Institutions Management: A Risk Management Approach, 7th Edition, 2011, McGraw-Hill