

1. Caracterização da Unidade Curricular

1.1. Designação da Unidade Curricular

1.1.1. Designação

Gestão de Riscos Financeiros

Curso(s):

Finanças Empresarias (P.L.)

Finanças Empresariais

1.1.2. Designation

Financial Risk Management

Course(s):

Degree in Corporate Finance

1.2. Sigla da área científica em que se insere

1.2.1. Sigla da área científica

FN

1.2.2. Scientific area's acronym

FN

1.3. Duração da Unidade Curricular

1.3.1. Duração

Semestral

1.3.2. Duration

Semestral

1.4. Total de horas de trabalho

1.4.1. Horas de trabalho

Horas de Trabalho: 0108:00

1.4.2. Working hours

Working hours: 0108:00

1.5. Total de horas de contacto

1.5.1. Horas de contacto

(T) Teóricas:	0000:00	(TC) Trabalho de Campo:	0000:00
(TP) Teórico-Práticas:	0045:00	(OT) Orientação Tutorial:	0000:00
(P) Práticas:	0000:00	(E) Estágio:	0000:00
(PL) Práticas Laboratoriais:	0000:00	(O) Outras:	0000:00
(S) Seminário:	0000:00		
Horas Contacto:	0045:00		

1.5.2. Contact hours

(T) Theoretical:	0000:00	(TC) Field Work:	0000:00
(TP) Theoretical-practical:	0045:00	(OT) Tutorial Guidance:	0000:00
(P) Practical:	0000:00	(E) Internship:	0000:00
(PL) Laboratory practices:	0000:00	(O) Other:	0000:00
(S) Seminar:	0000:00		
Contact Hours:	0045:00		

1.5.3. % Horas de contacto à distância

Sem horas de contacto à distância

1.5.4. % Remote contact hours

No remote hours

1.6. ECTS

4

2. Docente responsável e respetiva carga letiva na Unidade Curricular

2.1. Docente responsável e carga letiva (preencher o nome completo)

JOAQUIM PAULO VIEGAS FERREIRA DE CARVALHO

Sem carga letiva

2.2. Responsible academic staff member and lecturing load (fill in the full name)

JOAQUIM PAULO VIEGAS FERREIRA DE CARVALHO

No lecturing load

3. Outros docentes e respetivas cargas letivas na Unidade Curricular

3.1. Outros docentes e respetivas carga letivas

3.2. Other academic staff and lecturing load

4. Objetivos de aprendizagem

4.1. Objetivos de aprendizagem e a sua compatibilidade com o método de ensino (conhecimentos, aptidões e competências a desenvolver pelos estudantes)

No final do período curricular desta UC, o aluno deverá ser capaz de:

- O1. Adquirir competências na gestão dos riscos de mercado, de crédito, operacional e de taxa de juro.
- O2. Ser capaz de usar derivados para gerir riscos.
- O3. Saber aplicar metodologias de avaliação de risco baseadas no Value at Risk (VaR).
- O4. Adquirir os conhecimentos fundamentais para poder desempenhar as funções de analista de risco numa instituição financeira.

4.2. *Learning objectives and their compatibility with the teaching method (knowledge, skills and competencies to be developed by students)*

At the end of the course, students should be able to:

- LG1. Acquire skills in managing market, credit, operational, and interest rate risks.
- LG2. Be able to use derivatives to manage risks.
- LG3. Know how to apply risk assessment methodologies based on Value at Risk.
- LG4. Acquire the fundamental knowledge to be able to perform the duties of a risk analyst in a financial institution.

5. Conteúdos programáticos

5.1. Conteúdos

CP1. Introdução à Gestão de Riscos Financeiros

CP2. Risco de Mercado

CP3. Risco de Taxa de Juro

CP4. Risco de Crédito

CP5. Risco Operacional

CP6. Gestão de Riscos Financeiros e Operacionais nos Sectores da Banca, Segurador e Asset Management.

5.2. *Syllabus*

- S1. Introduction to Financial Risk Management
- S2. Market Risk
- S3. Interest Rate Risk
- S4. Credit Risk
- S5. Operational Risk
- S6. Financial and Operational Risk Management in the Banking, Insurance and Asset Management Sectors

6. Demonstração da coerência dos conteúdos programáticos

6.1. Demonstração da coerência dos conteúdos programáticos com os objetivos de aprendizagem da unidade curricular

A coerência dos conteúdos programáticos (CP) com os objetivos de aprendizagem (OA) decorre da seguinte interligação:

- O1 - CP2, CP3, CP4 e CP5
- O2 - CP2
- O3 - CP2, CP3 e CP4
- O4 - Todos os pontos dos conteúdos

6.2. *Demonstration of the syllabus coherence with the curricular unit's objectives*

The syllabus (S) coherence with the learning outcomes (LO) stems from the next interconnection:

- LG1 ? S2, S3, S4 and S5
- LG2 - S2
- LG3 ? S2, S3 and S4
- LG4 ? All syllabus contents

7. Metodologias de ensino

7.1. Metodologias de ensino e de aprendizagem específicas da unidade curricular articuladas com o modelo pedagógico

As aulas serão teórico-práticas, envolvendo as seguintes metodologias de aprendizagem:

- Expositivas, para apresentação de quadros teóricos.
- Participativas, com análise/resolução de exercícios e discussão de casos de estudo.
- Ativas, com realização de trabalhos grupo e individuais.
- Autoestudo, relacionadas com o trabalho autónomo.

7.2. *Teaching and learning methodologies specific to the curricular unit articulated with the pedagogical model*

Classes will be theoretical and practical, involving the following learning methodologies:

- Lectures, for presentation of theoretical frameworks.
- Participatory, with the analysis of exercises and discussion of case studies.
- Active, with group and individual work.
- Self-study, related to autonomous work.

8. Avaliação

8.1 Avaliação

A avaliação adotada tem como objetivo aferir o nível individual de aquisição de conhecimentos dos alunos. Para o efeito, ao longo do período letivo, os alunos terão os seguintes momentos de avaliação:

- Realização de um trabalho de grupo com uma ponderação de 40%.
- Um teste final sobre toda a matéria, com uma ponderação de 60%.

O teste e o exame final (época normal) ocorrerão na mesma data.

8.2 Evaluation

The assessment adopted aims to evaluate the student's level of knowledge acquisition. To this end, throughout the semester, students will have the following assessment moments:

- A group assignment, with a weighting of 40%.
- A written test on all the subjects taught during the semester, weighing 60%.

The test and the final exam (normal season) will occur on the same date.

9. Demonstração da coerência das metodologias

9.1. Demonstração da coerência das metodologias de ensino com os objetivos de aprendizagem da Unidade Curricular

As metodologias de ensino-aprendizagem visam desenvolver nos alunos competências e conhecimentos que lhes permitam atingir os objetivos de aprendizagem, com as seguintes interligações entre as metodologias de ensino-aprendizagem e os respetivos objetivos:

- Expositivas: Todos os objetivos
- Participativas: Todos os objetivos
- Ativas: Todos os objetivos
- Autoestudo: Todos os objetivos

O sistema de avaliação adotado visa aferir sobre o nível de concretização em cada aluno de todos os objetivos de aprendizagem identificados.

9.2. *Demonstration of the coherence between the teaching methodologies and the learning outcomes*

Teaching-learning methodologies aim to develop student's skills and knowledge that enable them to achieve learning objectives, with the following interconnections between teaching-learning methodologies and their objectives:

- Lectures: All Goals
- Participatory: All Goals
- Active: All Goals
- Self-Study: All Goals

The assessment system adopted aims to evaluate the level of achievement by each student of all identified learning objectives.

10. Bibliografia de consulta/existência obrigatória

Allen, Steven (2013). Financial Risk Management: A Practitioner's Guide to Managing Market and Credit Risk. 2nd Ed., Wiley

Hull, John (2023). Risk Management and Financial Institutions. 6th Ed., Wiley.

Jorion, Philippe (2011). Financial Risk Manager Handbook. 6th Ed., Wiley.

11. Observações

11.1. Observações

11.2. *Observations*
