



Universidade Presbiteriana

**Mackenzie**

Pró-Reitoria de Pesquisa e Pós-Graduação

Coordenadoria Geral de Pós-Graduação *Stricto Sensu*

## PLANO DE ENSINO

<b>Unidade Universitária:</b> Centro de Ciências Sociais e Aplicadas – CCSA		
<b>Programa de Pós-Graduação em Controladoria e Finanças Empresariais</b>		
<b>Curso:</b> <input type="checkbox"/> Mestrado Acadêmico <input checked="" type="checkbox"/> Mestrado Profissional <input checked="" type="checkbox"/> Doutorado Profissional		
<b>Disciplina:</b> Gestão de Riscos Corporativos		
<b>Professor:</b>		
<b>Carga horária:</b> 48 horas	<b>Créditos</b> 4	<input type="checkbox"/> Obrigatória <input checked="" type="checkbox"/> Optativa <input type="checkbox"/> Eletiva
<b>Ementa:</b> Introdução a gestão de risco. Fundamentos de gestão de risco. Regulação para instituições financeiras. Introdução ao Enterprise Risk Management. Modelos de ERM.		
<b>Objetivos:</b> Fornecer um framework para o entendimento da gestão de riscos corporativos e as oportunidades para sua aplicação em situações de negócio.		
<b>Conteúdo Programático:</b> <ul style="list-style-type: none"><li>• Introdução a gestão de risco<ul style="list-style-type: none"><li>• Conceitos básicos, objetivos e criação de valor</li><li>• Classificação do risco</li><li>• Técnicas de gestão de risco</li></ul></li><li>• Fundamentos de gestão de risco<ul style="list-style-type: none"><li>• Operacional, crédito, financeiro, liquidez, mercado, ambiental, político e legal</li></ul></li><li>• Regulação para instituições financeiras<ul style="list-style-type: none"><li>• Instituições seguradoras</li><li>• Instituições bancárias</li></ul></li><li>• Introdução ao Enterprise Risk Management</li><li>• Modelos de ERM</li></ul>		
<b>Metodologia:</b> Durante a disciplina os alunos serão expostos aos tópicos essenciais de pesquisa quantitativa, ao mesmo tempo em que aplicarão o conhecimento nas atividades que serão desenvolvidas ao longo da disciplina.		



**Critério de Avaliação:**

- Leituras e discussões com peso de 20%
- Apresentação de trabalhos com peso de 30%
- Elaboração de um artigo para congresso científico com peso de 50%

Segundo Regulamento Geral da Pós-Graduação *Stricto Sensu*, Art. 98, “Será considerado aprovado o aluno que obtiver, em cada disciplina obrigatória, optativa e nas atividades programadas o conceito final “A”, “B” ou “C”, conforme relação de conceitos a seguir:

I - A – excelente: corresponde às notas no intervalo entre os graus 9 e 10;

II - B – bom: corresponde às notas no intervalo entre os graus 8 e 8,9;

III - C – regular: corresponde às notas no intervalo entre os graus 7 e 7,9;

IV - R – reprovado: corresponde às notas no intervalo entre os graus 0 e 6,9”

**Bibliografia:**

01- SEAGEL, S. Corporate value of Enterprise Risk Management: the next step in business management. Wiley, 2011.

02- REJDA, G. E.; MICHEL J. M. Principles of risk management and insurance. Pearson Education Inc., 14th ed., 2020.

03- HUNZIKER, S. Enterprise risk management: modern approaches to balancing risk and reward. Springer, 2019.

04- OLSON, D. L.; WU, D. Enterprise risk management models. Springer, 3a ed., 2020.

05- WOOLDRIDGE, J. M. *Introdução à econometria: uma abordagem moderna*. 4a ed. Cengage Learning, 2017.

06- HOYT, R. E.; LIEBENBERG, A. P. The value of Enterprise Risk Management. *The Journal of Risk and Insurance*, v. 78, n. 4, 795-822, 2011.