



**UNIVERSIDADE DE FORTALEZA – UNIFOR**  
**VICE-REITORIA DE PÓS-GRADUAÇÃO – VRPG**  
**CENTRO DE COMUNICAÇÃO E GESTÃO – CCG**  
**PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ADMINISTRAÇÃO DE EMPRESAS – PPGA**

**PERÍODO DE REALIZAÇÃO:**

Abril 09, 16, 23

Maio 07, 14

**PROGRAMA DE DISCIPLINA**

**1. IDENTIFICAÇÃO**

Nome: GESTÃO DE RISCOS Local: E-14 Turma: 25(M)/10(D)

Código C/H: 15 h Créditos: 1 Linha: OM

Horário: 14 às 17 hs Dia: Terça-feira Tipo: Optativa

Professor: **Heber José de Moura**, Doutor Email: heberm@unifor.br

**2. EMENTA**

Estruturação de processos de análise de risco. Integração das abordagens qualitativa e quantitativa. Tomada de decisão sob condições de risco e incerteza.

**3. OBJETIVO**

Apresentar os elementos relacionados a gestão de riscos, possibilitando a sua análise e quantificação.

**4. UNIDADES PROGRAMÁTICAS**

**1.1 Estruturação de problemas de análise de riscos**

- Conceitos e classificações
- Etapas da análise de riscos
- Planejamento, identificação, análise e tratamento dos riscos.
- Frameworks e modelos para gestão do risco
- Formação matriz de riscos
- Aplicações de processos de gerenciamento

**1.2 Tomada de decisão em situações de incerteza e risco**

- Análise da decisão
- Simulação pelo Método de Monte Carlo
- Otimização com simulação

**1.3 Modelagem multicritério para análise de decisões sob situações de risco**

- Modelo SMART
- Incorporação da simulação do risco

**5. METODOLOGIA**

- Leitura antecipada pelos alunos dos textos indicados antes de cada aula.

- Debate a respeito dos pontos mais relevantes constantes dos textos apresentados
- Aplicação do conteúdo apresentado a uma situação-problema real apresentada pelo professor
- Realização de trabalhos equivalentes nas respectivas áreas

## 6. PLANO DE AULA

<p>1º e 2º Encontros (dias 09 e 16 de abril):</p> <p><b>Estruturação de um problema de análise de riscos</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Antes do 1º encontro os textos 1, 2, 3 e 4 deverão ter sido lidos;</li> <li>• Os participantes apresentarão o seu tema de interesse para efeito de formulação de um plano de gestão do risco;</li> <li>• Serão discutidos os principais aspectos relacionados à formulação de um plano de gestão de risco;</li> <li>• Os participantes iniciarão a formulação dos respectivos modelos de gestão de risco, para entregá-los posteriormente na forma de <i>mini-papers</i>;</li> <li>• Os artigos 4, 5, 6 e 7 complementarão a elaboração do modelo de gestão do risco.</li> </ul>	<p>Textos (disponibilizados no Unifor On Line, na pasta <i>Artigos</i>)</p> <p>1-Gestão de Riscos</p> <p>2-Gestão de riscos - aplicação a projetos de TI</p> <p>3-Gestão do risco na Administração Pública - Etapas</p> <p>4-Gestão do risco - Integração entre abordagens qualitativa e quantitativa</p> <p>5-Risk project management</p> <p>6-Supply chain risk management in French companies</p> <p>7-Data Loss Risk : A Multivariate Statistical Methodology Proposal</p>
<p>3º e 4º Encontros (23 de abril e 07 de maio):</p> <p><b>Tomada de decisão sob condições de incerteza e risco</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Leitura dos capítulos 5 e 6 do livro antes do 3º Encontro;</li> <li>• Desenvolvimento de modelo de análise de decisão para aplicação na área de interesse;</li> <li>• Leitura do capítulo 7 do livro 1 e do artigo 8.</li> <li>• Desenvolvimento de modelo de simulação para aplicação na área de interesse;</li> </ul>	<p>Textos (disponibilizados no Unifor On Line, na pasta <i>Artigos</i>)</p> <p>Livro : Decision Analysis for Management Judgment 3rd Ed - Paul Goodwin</p> <p>Artigo</p> <p>8- Simulação de Monte Carlo com Excel</p>

<ul style="list-style-type: none"> <li>• Elaboração de <i>mini-paper</i> sobre a aplicação de um dos modelos na área de interesse.</li> </ul>	
<p>5º Encontro (14 de maio):</p> <p><b>Modelagem multicritério em situações de risco</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Leitura antecipada dos capítulos 2 e 3 do livro..</li> <li>• Desenvolvimento de <i>mini paper</i></li> </ul>	<p>Texto adotado (disponibilizado no Unifor On Line, na pasta <i>Artigos</i>)</p> <p>1 - Decision Analysis for Management Judgment 3rd Ed - Paul Goodwin</p>

## 7. BIBLIOGRAFIA

Borges, J F ; Moura, H J *Integração entre abordagens qualitativa e quantitativa para a mitigação do risco operacional: estudo no Banco Central do Brasil*, ENANPAD São Paulo: 2014

Carnevali, M A *ciência do gerenciamento de riscos em projetos*, PMI : São Paulo, 2017

Cavalcante, M; Moura, H J *Fatores de risco na construção civil*, Tese de Doutorado, UNIFOR, 2019.

Goodwin P; Wright G *Decision Analysis for Management Judgment*, 3<sup>rd</sup> ed, John Wiley & Sons Ltd, USA: 2004

Miorando, R F *Modelo econômico-probabilístico de análise de risco em projetos de TI, tese de doutorado apresentada à escola de engenharia da UFRGS Porto Alegre: 2010. Disponível em <https://www.lume.ufrgs.br/handle/10183/28817>*

Moura, H..JM, Carmona, C.U.M. *Data Loss Risk : A Multivariate Statistical Methodology Proposal*, Anais doXX SEMEAD Seminários em Administração, USP, São Paulo, 2017

Fernandes, C A B A *Gerenciamento de riscos em projetos: como usar o Microsoft Excel para realizar a simulação Monte Carlo*, disponível em <https://www.coursehero.com/file/9919060/MonteCarloExcel/>

## 8. AVALIAÇÃO

Itens	Peso
Realização dos trabalhos	30%
Assiduidade, apresentações e participação nos debates	20%
<i>Mini Paper</i> sobre aplicações em áreas de interesse	50 %

Doutor em Administração pela FGV/SP (1995) em Finanças e Métodos Quantitativos, com Pós-Doutorado em Risco Operacional realizado na UFPE com o Dr Charles Ulises de Montreuil Carmona. Mestre em Análise de Sistemas pelo Instituto Nacional de Pesquisas Espaciais-INPE (1975) e graduado em Estatística pela Universidade Federal de Pernambuco (1972). Atualmente é Professor titular dos cursos de doutorado e mestrado em Administração e mestrado em tecnologia da enfermagem da Universidade de Fortaleza. Tem experiência na área de Métodos Quantitativos Aplicados , Estatística e Administração Financeira, atuando principalmente nos seguintes temas: Métodos inovadores para o ensino das finanças , Risco e Modelagem Empresarial. Atualmente

desenvolve instrumentos de apoio acadêmico na forma de *cases virtuais* e cursos EAD para utilização nas áreas de graduação e pós-graduação da Universidade de Fortaleza, tendo publicado em 2014 a obra “Aprendendo Finanças Através de uma Empresa virtual” pela Editora Ciência Moderna.

---