

Recebido: 16/10/17

Delec: 26/10/16

TID: 201291282

1113783

102617

Acesso restrito em
2 anos

Thesis License Agreement

Name: Mário Rui dos Santos Seixas

E-mail: mseixas93@gmail.com

Phone number: 962769563

Identity Card/Passaport: 14471619

Nationality: Portuguese

Master's (Dissertation) ☒

Master's (Project) ☐

Title of the Dissertation / Project:

Optimal Value-at-Risk Policy: A model for minimizing the daily capital charge

Supervisor (s): António Barbosa

Conclusion Year: 2016

Master course designation: Master in Finance

I declare under oath that the dissertation/project now delivered is the final version. Otherwise, it will be later presented the version that the jury has approved.

I grant to ISCTE-IUL and its agents a non-exclusive license to archive and make accessible, through its institutional repository in the conditions below, my dissertation or project, in whole or in part, in digital format:

1. ☐ Immediate availability of work set for worldwide access;
2. ☒ Availability of work set for exclusive access in ISCTE-IUL during the period of ☐ 1 year,
3. ☒ 2 years or ☐ 3 years, and after the time appointed I authorize worldwide access.
4. ☐ Availability of work set for exclusive access in ISCTE-IUL.
5. ☐ Embargo (Granted in exceptional circumstances by justified reason. Failure to provide documentation in support of the request, invalidate the same).

I hold all copyright of the dissertation or project and the right to use in future works (such as articles or books).

ISCTE-IUL, 30 de setembro de 2016

Signature:

Mário Rui dos Santos Seixas

DIREÇÃO-GERAL DE ESTATÍSTICAS
DA EDUCAÇÃO E CIÊNCIA

Registo Nacional de Teses e Dissertações

[Início](#)[Doutoramentos](#)[Mestrados](#)[Pesquisa](#)[Contactos](#)[Ajuda](#)[Terminar sessão](#)

Dados de identificação

TID: 201291282

*Nome do Autor: Mário Rui dos Santos Seixas

*Sexo: ☒ Masculino ☐ Feminino

*Data de nascimento: 10 - 7 - 1993

*N.º de identificação: 14471619

*Tipo de identificação: B.I. Nacional/Cartão de Cidadão

*País de nacionalidade: Portugal

Outra nacionalidade:

Morada:

Telefone:

*E-mail: Mario_Seixas@iscte.pt

Outro(s) E-mail(s):

Dados do registo de atribuição de grau mestre

*Estabelecimento: 6800-ISCTE - Instituto Universitário de Lisboa

*Unidade orgânica: 6800-ISCTE - Instituto Universitário de Lisboa

*Curso: 9294-Finanças (M2)

*Especialização: 1000017-Sem especialização

*Título do trabalho: Optimal Value-at-Risk Policy: A model for minimizing the daily capital charge

Área de educação e formação do curso: Finanças, Banca e Seguros

*Palavras-chave [Separadas por ':'] : Market Risk, Basel Accords, Value at Risk; Capital Requirements; Dynamic Programming; O

*Orientador(es):

	Nome	ORCID	N.º de identificação	Tipo de identificação
1	António Manuel Rodrigues Guerra Ba		11517922	B.I. Nacional/Cartão de Cidadão
2				escolher

Coorientador(es):

*Data de concessão do grau: 26 - 10 - 2016

*Classificação final: 19 valores

*Curso em parceria? ☐ Sim ☒ Não

Identificador RCAAP: [http://hdl.handle.net/xxxxx]

Observações:

Gravar

Cancelar

« Voltar

Remover registo atual

Utilizador: U6800 - Renates - 6800

Desenvolvimento: DGEEC - Direção-Geral de Estatísticas da Educação e Ciência

31/1/2017