

**Mestrado em Auditoria e Finanças**

Mestrado, 2º Ciclo

Plano: Despacho n.º 10361/2016 - 17/08/2016

**Ficha da Unidade Curricular: Instrumentos Financeiros de Gestão de Risco**

ECTS: 5; Horas - Totais: 135.0, Contacto e Tipologia, TP:30.0;

Ano | Semestre: 1 | S2

Tipo: Obrigatória; Interação: Presencial; Código: 392511

Área Científica: Finanças

**Docente Responsável**

José Manuel Barros Pinheiro Nogueira

Professor Adjunto

**Docente(s)**

José Manuel Barros Pinheiro Nogueira

Professor Adjunto

**Objetivos de Aprendizagem**

Os alunos deverão dominar conhecimentos básicos sobre os mercados e ativos financeiros, de forma a conseguirem aplicar técnicas de gestão do risco financeiro. Aprender a selecionar a melhor decisão de investimento, avaliando os produtos, técnicas e analisando os riscos inerentes e os fatores

**Objetivos de Aprendizagem (detalhado)**

Os alunos deverão dominar conhecimentos básicos sobre os mercados e ativos financeiros, de forma a conseguirem aplicar técnicas de gestão do risco financeiro. Aprender a selecionar a melhor decisão de investimento, avaliando os produtos, técnicas e analisando os riscos inerentes e os fatores

**Conteúdos Programáticos**

1 - Mercado financeiro

- 2 - A problemática dos riscos e da sua gestão
- 3 - Mercado eficiente
- 4 - Estratégias de Diversificação
- 5 - Estratégias em decisões de investimento
- 6 - Instrumentos do mercado de derivados

### **Metodologias de avaliação**

A avaliação para dispensa de Exame é de 10 valores. Realização de trabalhos e apresentações individuais.

### **Software utilizado em aula**

- Processador de texto Microsoft Word
- Folha de cálculo Microsoft Excel

### **Estágio**

### **Bibliografia recomendada**

- Ferreira, D. e , . (2010). *Futuros e Outros Derivados* Lisboa: Edições Silabo
- Pires, C. (2008). *Mercados e Investimentos Financeiros* Lisboa: Escolar Editora
- Brealey, R. e Myers, S. e Allen, F. (2007). *Princípios de Finanças Empresariais* (Vol. ). : McGraw-Hill
- Bodie, Z. e Kane, A. e Marcus, A. (2014). *Investments* (Vol. ). : McGraw-Hill

### **Coerência dos conteúdos programáticos com os objetivos**

Os conteúdos programáticos permitem aos alunos atingirem os objetivos propostos na medida que transmitem o conjunto de conhecimentos e elementos necessários para as decisões de investimentos e para a gestão de riscos.

### **Metodologias de ensino**

O ensino da disciplina será feito através de aulas presenciais, estudo de casos práticos e elaboração de trabalhos.

### **Coerência das metodologias de ensino com os objetivos**

A metodologia de ensino, nomeadamente o estudo de casos práticos e trabalhos, irá permitir aos

alunos a aquisição dos conhecimentos necessários sobre a decisão de investimentos, e a sua avaliação.

**Língua de ensino**

Português

**Pré-requisitos**

Não tem

**Programas Opcionais recomendados**

**Observações**

---

**Docente responsável**

---