

✱ Escola Superior de Gestão de Tomar

Ano letivo: 2024/2025

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

Renato Heitor Correia Domingues

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

- 7- Opções, futuros e forwards
- 8- Instrumentos derivados da crise financeira de 2008

Conteúdos Programáticos (detalhado)

- 1 - Mercado financeiro
 - 1.1. Mercado primário, secundário, mercado organizado e mercado OTC.
- 2 - A problemática dos riscos e da sua gestão
 - 2.1. Risco cambial
 - 2.2. Hedging e proteção cambial
- 3 - Mercado eficiente
- 4 - Estratégias de Diversificação
- 5 - Estratégias em decisões de investimento
- 6 - Instrumentos do mercado de derivados
- 7- Opções, futuros e forwards
- 8- Instrumentos derivados da crise financeira de 2008

Metodologias de avaliação

Teste de avaliação com parte prática em excel.

Software utilizado em aula

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

Estágio

Bibliografia recomendada

- Bodie, Z. e Kane, A. e Marcus, A. (2014). *Investments*. (Vol.). 10ª, McGraw-Hill.
- Brealey, R. e Myers, S. e Allen, F. (2007). *Princípios de Finanças Empresariais*. (Vol.). 8a, McGraw-Hill.
- Ferreira, D. e , . (2010). *Futuros e Outros Derivados*. 2, Edições Silabo. Lisboa
- Pires, C. (2008). *Mercados e Investimentos Financeiros*. 2, Escolar Editora. Lisboa

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 e online.

Coerência das metodologias de ensino com os objetivos

Teste escrito: 100%.

Língua de ensino

Português

Pré-requisitos

Não tem

Programas Opcionais recomendados

Observações

Objetivos de Desenvolvimento Sustentável:

- 6 - Garantir a disponibilidade e a gestão sustentável da água potável e do saneamento para todos;
 - 12 - Garantir padrões de consumo e de produção sustentáveis;
-

Docente responsável
