

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

Pedro Miguel Azeitona Gonzaga Barroso

Professor Adjunto Convidado

Docente(s)

Pedro Miguel Azeitona Gonzaga Barroso

Professor Adjunto Convidado

Objetivos de Aprendizagem

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

Objetivos de Aprendizagem (detalhado)

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

Conteúdos Programáticos

1 - Conceitos gerais do mercado financeiro

- 2 - A problemática dos riscos e da sua gestão
- 3 - Instrumentos do mercado de derivados
- 4- Estratégias com opções em decisões de investimento e especulação
- 5- Forward ou contratos a prazo
- 6- Mercados e contratos futuros
- 7 – Opções
- 8 - Swaps

Conteúdos Programáticos (detalhado)

- 1 - Conceitos gerais do mercado financeiro (Sistema Financeiro, Tipos de Mercado, Caraterização dos Produtos)
- 2 - A problemática dos riscos e da sua gestão (Risco Cambial, Risco Taxa de Juro, Risco do mercados de ações, Risco de matérias primas e risco de crédito)
- 3 - Instrumentos do mercado de derivados
- 4- Estratégias com opções em decisões de investimento e especulação
- 5- Forward ou contratos a prazo (forward cambial, forward sobre taxa de juros)
- 6- Mercados e contratos futuros (Tipos de contratos, caraterísticas dos contratos de futuros)
- 7 – Opções (Opções sobre contratos futuros, opções sobre futuros cambiais, opções sobre futuros de taxa de juro)
- 8 - Swaps (caraterísticas)

Metodologias de avaliação

A avaliação para dispensa de Exame é de 10 valores. Realização de trabalhos individuais (20%) e testes escritos individuais (80%)

Software utilizado em aula

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

Estágio

Bibliografia recomendada

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