

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

Luís António Antunes Francisco

Professor Adjunto

Docente(s)

José Miguel Ferreira Graça

Assistente 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, Caracterização 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, características 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

- Ferreira, D. e , . (2010). *Futuros e Outros Derivados* Lisboa: Edições Silabo
- Pires, C. (2008). *Mercados e Investimentos Financeiros* Lisboa: Escolar Editora

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

Docente responsável
