



Escola Superior de Gestão de Tomar

Ano Letivo 2015/2016

### **Mestrado em Auditoria e Análise Financeira**

Mestrado, 2º Ciclo

Plano: DESPACHO N.º 13851 DE 14/10/2011

### **Ficha da Unidade Curricular: Investimentos Financeiros**

ECTS: 5; Horas - Totais: 135.0, Contacto e Tipologia, TP:41.0;

Ano | Semestre: 1|S1; Ramo: Tronco Comum;

Tipo: Obrigatória; Intereração: Presencial; Código: 30075

Área Científica: Financeiras

#### **Docente Responsável**

Pedro Miguel Azeitona Gonzaga Barroso

Professor Adjunto Convidado

#### **Docente e horas de contacto**

Pedro Miguel Azeitona Gonzaga Barroso

Professor Adjunto Convidado, TP: 41;

### **Objetivos de Aprendizagem**

No final do curso os alunos devem ter os conhecimentos necessários sobre os mercados financeiros e investimentos financeiros,

Avaliar as melhores alternativas de investimento tendo em conta a rentabilidade e o risco dos diversos produtos financeiros, com base nas teorias e modelos existentes.

### **Conteúdos Programáticos**

- 1 – Conceitos Gerais
- 2 – Teoria da Gestão de Carteiras
- 3 – Modelo de Arbitragem
- 4 – Modelo de Equilíbrio de Ativos Financeiros
- 5 – Eficiência do Mercado de Capitais.
- 6 – Análise e Gestão de Carteiras
- 7 – Produtos Derivados

### **Conteúdos Programáticos (detalhado)**

- 1 – Conceitos Gerais: Mercados e Investimentos Financeiros.
- 2 – Teoria da Gestão de Carteiras: aversão ao risco, escolha da carteira óptima, Modelos de factores.
- 3 – Modelo de Arbitragem: APT
- 4 – Modelo de Equilíbrio de Ativos Financeiro: CAPM.
- 5 – Eficiência do Mercado de Capitais.
- 6 – Análise e Gestão de Carteiras: Carteiras de Ações, Carteiras de Obrigações, Carteiras Mistas
- 7 – Produtos Derivados: Valorização de Opções, Contratos a Prazo e Futuros.

### **Metodologias de avaliação**

Avaliação contínua (periódica) e exame.

**Software utilizado em aula**

**Estágio**

Não aplicável.

**Bibliografia recomendada**

- Pires, C. (2008). *Mercados e Investimentos Financeiros*. Lisboa: Escolar Editora
- Afonso, A. (2004). *Introdução à economia Financeira*. Lisboa: Escolar Editora.

**Coerência dos conteúdos programáticos com os objetivos**

Cada um dos objectivos delineados está directamente relacionado com cada capítulo do programa

**Metodologias de ensino**

Método expositivo em aulas teórico-práticas, com ampla realização de exercícios e casos práticos.

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

A utilização de uma metodologia expositiva permitirá ao aluno obter conhecimentos básicos essenciais para a resolução dos casos práticos tendo em vista os objectivos delineados

**Língua de ensino**

Português

**Pré requisitos**

Não aplicável.

**Programas Opcionais recomendados**

Não aplicável.

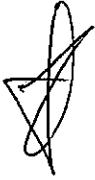
**Observações**

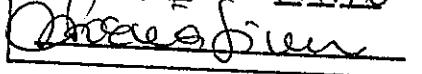
---

**Docente Responsável**



**Diretor de Curso, Comissão de Curso**



Homologado pelo C.T.C.	
Acta n.º 84 Data 6/1/16	
	

**Conselho Técnico-Científico**

