

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; Interação: 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

Conselho Técnico-Científico

