



INSTITUTO POLITÉCNICO DE TOMAR

ESCOLA SUPERIOR DE GESTÃO DE TOMAR

CURSO Licenciatura em Gestão e Administração
Bancária

ANO LECTIVO 2013/2014

FICHA DA UNIDADE CURRICULAR

Unidade Curricular Gestão de Activos e Passivos nas Instituições Financeiras
Área Científica Financeiras

Classificação curricular OBRIGA. **Ano / Semestre** 3º/1º

Créditos ECTS	Horas de trabalho do aluno	Carga horária das sessões de ensino	
		Natureza Colectiva (NC)	Orientação Tutorial (OT)
5	135	T: 30 + P: 30	

DOCENTES

Responsável Luís António Antunes Francisco

Teóricas Paulo Jorge da Silva Santos

Teórico-Práticas

Práticas Paulo Jorge da Silva Santos

Prático-Laboratorial

CATEGORIA

Eq.Prof.Adjunto

Assistente Convidado

Assistente Convidado

OBJECTIVOS

- Desenvolver a capacidade para caracterizar e sistematizar os riscos inerentes à actividade bancária e as suas interligações;
- Conhecer os principais modelos de medição e gestão desses riscos e dos principais instrumentos financeiros utilizados na cobertura de riscos de uma Instituição Financeira;
- Permitir a delineação de estratégias dinâmicas de gestão de Activos e Passivos, permitindo conhecer os principais tipos de risco e de rentabilidade inerentes aos modelos de gestão..

PROGRAMA PREVISTO

- 1- O Mercado Financeiro
 - 1.1. Breve caracterização
 - 1.2. Instrumentos Financeiros
 - 1.3. O papel da Banca na política económica
- 2 – Enquadramento da Gestão de Activos e Passivos
 - 2.1. A Gestão Bancária
 - 2.2. Elementos fundamentais da gestão de Activos e Passivos
 - 2.3. Regulamentação e Supervisão
- 3 – Gestão Global de Activos e Passivos na Banca
 - 3.1. Características

- 3.2. Riscos envolvidos (Risco País, Risco de Crédito, Risco Liquidez, Risco Cambial, Risco Taxa de Juro, Riscos Contingenciais)
- 4 – Modelos de Gestão de Activos e Passivos
 - 4.1. Modelos de Risco: País, Crédito, Liquidez, Cambial e de Taxa de Juro
 - 4.2. Modelos de Risco Contingenciais
- 5 – Gestão Dinâmica de Activos e Passivos
 - 3.1. Introdução
 - 5.2. Rentabilidade e Risco de Activos e Passivos



BIBLIOGRAFIA

- Antl, Boris - **Management of Interest Rate Risk; Euromoney.**
- Lockett, Dudley G. - **Money and Banking; McGraw-Hill.**
- Wilson, J.S.G. – **Managing Bank Assets and Liabilities; Euromoney.**
- Caiado, Aníbal Campos – **Gestão de Instituições Financeiras**
- Mota, António S. Gomes; Tomé, Jorge H. Correia – **Mercado de Títulos – Uma Abordagem Integrada; Texto Editora**
- Normas do Banco de Portugal
- Relatório e Contas de IC's nacionais

WEBGRAFIA

CRITÉRIOS DE AVALIAÇÃO

Avaliação Contínua

Avaliação Periódica

Frequência

No decorrer do ano lectivo serão facultados aos alunos casos práticos para resolução, estando prevista a realização de 1 (uma frequência).

Avaliação Final

Os alunos são dispensados de exame final se a nota frequência for igual ou superior a 10 (dez) valores.

Exame final

Se a classificação desta prova for igual ou superior 10 (dez) valores é considerado aprovado na disciplina.

Handwritten signature and initials

OBSERVAÇÕES

HORÁRIO DE ORIENTAÇÃO TUTORIAL

Dia

Horário

Local

etc - 17.01.2014

Ata nº 45

Ponto 6 d)

Handwritten signature