

INSTITUTO POLITÉCNICO DE TOMAR
ESCOLA SUPERIOR DE GESTÃO DE TOMAR

CURSO Curso de Gestão e Administração Bancária
1º Ciclo **ANO LECTIVO** 2014/2015

FICHA DA UNIDADE CURRICULAR

Unidade Curricular GESTÃO DE ATIVOS E PASSIVOS NAS INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS **Código** 992529
Área Científica FINANCEIRA
Tipo Obrigatória **Ano / Semestre** 3º/1º

Créditos ECTS	Horas Totais de Trabalho	Horas de Contacto (HC)						
		T	TP	P	PL	OT	E	Outra
5	135	30.0	00.0	30.0	0.0	0.0	0.0	0.0

Docentes		Categoria	Nº de HC
Responsável	Luís António Antunes Francisco	Professor Adjunto	
Teóricas	Bruno Miguel Silva Valada	Equiparado Assistente 1º Triénio	30
Teórico-Práticas			
Práticas	Bruno Miguel Silva Valada	Equiparado Assistente 1º Triénio	30
Prática Laboratorial			
Orientação Tutorial			
Estágio			

Objectivos de Aprendizagem

Caraterizar e sistematizar os riscos inerentes à atividade bancária. Conhecer os

principais modelos de medição e gestão desses riscos e dos principais instrumentos financeiros utilizados na cobertura de risco de uma instituição financeira. Permitir a delineação de estratégias dinâmicas de gestão de Ativos e Passivos, permitindo conhecer os principais tipos de risco e de rentabilidade inerentes aos modelos de gestão.



Conteúdos Programáticos

- 1- Política económica e gestão bancária
- 2- Mercados financeiros – caracterização e perspectivas
- 3- Elementos fundamentais de gestão de ativos e passivos na Banca
- 4- Riscos envolvidos na gestão de ativos e passivos
- 5- Modelos de gestão de risco país e risco de crédito
- 6- Modelos de gestão de risco de liquidez
- 7- Modelos de gestão de risco de taxa de juro e cambial
- 8- Modelos de gestão de risco contingenciais
- 9- Gestão dinâmica de ativos e passivos

Coerência dos conteúdos programáticos com os objectivos

Os conteúdos programáticos da unidade curricular em questão têm como objetivo que os alunos obtenham a capacidade de caracterizar e sistematizar os riscos inerentes à atividade bancária e conhecer os principais modelos de medição e gestão desses riscos e dos principais instrumentos financeiros utilizados na cobertura de risco de uma instituição financeira

Metodologias de ensino

Aulas teórico-práticas onde se propõe a realização de casos práticos

Coerência das metodologias de ensino com os objectivos

Disponibilização das apresentações elaboradas pelo docente com todos os conteúdos programáticos incluídos no programa da disciplina; Discussão de estudos de caso.

Metodologias de avaliação

Testes escritos intercalares e prova de frequência

Pré requisitos

Não aplicável

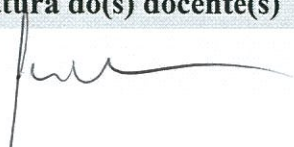
Bibliografia principal

- Luckett, Dudley G.; Money and Banking, McGraw-Hill
- Antl, Boris.; Management of Interest rate Risk, Euromoney
- Relatórios e Contas de Instituições de Crédito Nacionais
- Normas do Banco de Portugal

Software

Observações

Assinatura do(s) docente(s)



Homologado pelo C.T.C.
Acta n.º 58 Data 22/9/2014
