



INSTITUTO POLITÉCNICO DE TOMAR
ESCOLA SUPERIOR DE GESTÃO DE TOMAR

PL

CURSO	Curso de Gestão e Administração Bancária (Pós-Laboral) 1º Ciclo	ANO LECTIVO	2014/2015
--------------	--	------------------------	-----------

FICHA DA UNIDADE CURRICULAR

Unidade Curricular	Análise de Risco	Código	992533
Área Científica	Financeira		
Tipo	Obrigatória	Ano / Semestre	3/S2

Créditos ECTS	Horas Totais de Trabalho	Horas de Contacto (HC)						
		T	TP	PL	P	OT	E	Outra
5	135.0	30.0	0.0	0.0	30.0	0.0	0.0	0.0

Docentes		Categoria	Nº de HC
Responsável	- Ricardo Jorge Viegas Covas	- Professor Adjunto	
Teóricas	- Ricardo Jorge Viegas Covas	- Professor Adjunto	30
Teórico-Práticas			
Prática Laboratorial			
Prática	- Ricardo Jorge Viegas Covas	- Professor Adjunto	30
Orientação Tutorial			
Estágio			

Objectivos de Aprendizagem

Pretende-se apresentar as ferramentas essenciais ao apreçamento, de análise e de gestão de risco decorrente da tomada de posições em mercado, assim como um conjunto de regras a lidar com incerteza e risco.

Conteúdos Programáticos (resumido)

PL

I – Mercados Financeiros, II – Árvores binomiais, III – Modelos em árvore para acções e opções, IV – Modelos de Black-Scholes, V – Letras Gregas, VI - Risco de Crédito.

Conteúdos Programáticos (detalhado)

I – Mercados Financeiros, II – Árvores binomiais, III – Modelos em árvore para acções e opções, IV – Modelos de Black-Scholes, V – Letras Gregas, VI - Risco de Crédito.

Coerência dos conteúdos programáticos com os objectivos

Os conteúdos programáticos estão desenhados para que o aluno seja capaz de entender os fundamentais do apreçamento, análise e de gestão de risco decorrente da tomada de posições em mercado, assim como um conjunto de regras a lidar com incerteza e risco de crédito.

Metodologias de ensino

Aulas Teóricas e Práticas em ambiente laboratorial.

Coerência das metodologias de ensino com os objectivos

As aulas serão eminentemente práticas pretendendo-se que o aluno apreenda a teoria em causa mas que, em concreto, seja capaz de fazer e de decidir em situações e problemas concretos. Desta forma, as aulas serão centradas na resolução de problemas para os quais será necessário o acompanhamento por parte do docente e o software apropriado.

Metodologias de avaliação

Teste Final

Pré requisitos

Não aplicável

Bibliografia principal (máx 4 ref.)

- Capinski, M. (2003). *An Introduction to Financial Engineering*. Springer: Springer
- Neftci, S. (2008). *Principles of Financial Engineering*. Academic Press: Academic Press
- Stampfli, J. e Goodman, V. (2009). *The Mathematics of Finance*. AMS: American Mathematical Society

Software

Observações

Docente

Pleny

Diretor de Curso



Homologado pelo C.T.C.
Acta.n.º 68 Data 22/04/2015
[Signature]