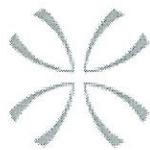


PL



INSTITUTO POLITÉCNICO DE TOMAR  
ESCOLA SUPERIOR DE GESTÃO DE TOMAR

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

**FICHA DA UNIDADE CURRICULAR**

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

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

<b>Docentes</b>		<b>Categoria</b>	<b>Nº de HC</b>
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**

2

## Observações

Docente



Diretor de Curso



Homologado pelo C.T.C.

Acta n.º 68 Data 22/04/2015

