

INSTITUTO POLITÉCNICO DE TOMAR  
ESCOLA SUPERIOR DE GESTÃO DE TOMAR

<b>CURSO</b>	<b>Curso de Mestrado em Auditoria e Análise Financeira 2º Ciclo</b>	<b>ANO LECTIVO</b>	2014/2015
--------------	---	--------------------	-----------

**FICHA DA UNIDADE CURRICULAR**

<b>Unidade Curricular</b>	<b>Gestão de Risco</b>	<b>Código</b>	<b>300718</b>
<b>Área Científica</b>	<b>Financeira</b>		
<b>Tipo</b>	Optativa	<b>Ano / Semestre</b>	1/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	0.0	41.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

<b>Docentes</b>		<b>Categoria</b>	<b>Nº de HC</b>
Responsável	- Ricardo Jorge Viegas Covas	- Professor Adjunto	41.0
Teóricas			
Teórico-Práticas	- Ricardo Jorge Viegas Covas	- Professor Adjunto	41.0
Prática Laboratorial			
Prática			
Orientação Tutorial			
Estágio			

**Objectivos de Aprendizagem**

No final do curso os alunos devem ter uma formação sólida nos domínios da Avaliação e Gestão do Risco. Simultaneamente desenvolver técnicas básicas de modelação de produtos derivados e explicar como podem ser aplicáveis nas várias circunstâncias

plm

práticas de gestão do risco da empresa.

### **Conteúdos Programáticos (resumido)**

Teorias e princípios da gestão da carteira de riscos da empresa. Utilização de instrumentos financeiros derivados em corporate finance. Opções exóticas e inovação financeira.

### **Conteúdos Programáticos (detalhado)**

Teorias e princípios da gestão da carteira de riscos da empresa. Utilização de instrumentos financeiros derivados em corporate finance. Opções exóticas e inovação financeira.

### **Coerência dos conteúdos programáticos com os objectivos**

### **Metodologias de ensino**

Aulas presenciais

### **Coerência das metodologias de ensino com os objectivos**

### **Metodologias de avaliação**

Frequencia e exame

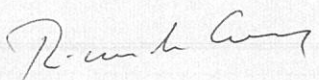

### **Pré requisitos**

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

**Observações**

Docente	Diretor de Curso
	

Homologado pelo C.T.C.  
Actam.º 43 Data 29/15  
