



INSTITUTO POLITÉCNICO DE TOMAR

ESCOLA SUPERIOR DE GESTÃO DE TOMAR

CURSO

MESTRADO EM AUDITORIA E ANÁLISE
FINANCEIRA

ANO LECTIVO

2010/2011

FICHA DA UNIDADE CURRICULAR

Unidade Curricular	Gestão de Carteiras		
Área Científica	Financeiras		
Classificação curricular	Optativa	Ano / Semestre	2º/1º

Créditos ECTS	Horas de trabalho do aluno	Carga horária das sessões de ensino	
		Natureza Colectiva (NC)	Orientação Tutorial (OT)
4	108	TP:32	

DOCENTES		CATEGORIA
Responsável	Florbela da Cruz Razina	Formadora externa
Teóricas		
Teórico-Práticas	Florbela da Cruz Razina	Formadora externa
Práticas		
Prático-Laboratorial		

OBJECTIVOS

Proporcionar aos mestrandos a aprendizagem e conhecimentos dos principais instrumentos e técnicas de gestão de carteiras, dotando-os das metodologias adequadas à avaliação do desempenho de carteiras de activos financeiros, considerando a gestão do risco e a utilização de instrumentos financeiros derivados.

PROGRAMA PREVISTO

- 1- Instrumentos financeiros e fundos de investimento: introdução, principais conceitos e características
- 2- Mercados de capitais: estrutura e funcionamento
- 3- Rendibilidade e risco: rendibilidade e risco de activos, de carteira de cativos, determinação da fronteira eficiente, escolha de carteira óptima
- 4- Introdução do activo sem risco e da linha do mercado de capitais
- 5- Modelos de índice simples e multi-índice
- 6- diversificação internacional (consideração do risco cambial)
- 7- introdução à utilização de instrumentos financeiros derivados na cobertura de carteiras de investimento.

BIBLIOGRAFIA

Elton, Edwin J. e Gruber, Martin J., MODERN PORTFOLIO THEORY AND INVESTMENT ANALYSIS, Ed. John Wiley & Sons

WEBGRAFIA**CRITÉRIOS DE AVALIAÇÃO**

Avaliação Contínua	Sim
Avaliação Final	Frequência /exame

OBSERVAÇÕES**HORÁRIO DE ORIENTAÇÃO TUTORIAL**

Dia	Horário	Local
-----	---------	-------

30.07.11

febreira da Cruz Paz