



MINISTÉRIO DA CIÊNCIA, TECNOLOGIA E ENSINO SUPERIOR
DIRECÇÃO-GERAL DO ENSINO SUPERIOR
INSTITUTO POLITÉCNICO DE TOMAR

ESCOLA SUPERIOR DE GESTÃO DE TOMAR

14

LICENCIATURA EM AUDITORIA E FISCALIDADE

NOVOS INSTRUMENTOS FINANCEIROS II

4º ANO - 2º SEMESTRE

Ano Lectivo 2007/2008

REGIME SEMESTRAL

Plano de Estudos: 1032

CARGA HORÁRIA – 4 (T/P)

DOCENTE: Pedro Manuel Frouco Marques
Equiparado a Professor Adjunto

OBJECTIVO

Dotar os alunos dos conhecimentos básicos sobre produtos derivados, nomeadamente *swaps*, futuros e opções entre outros instrumentos financeiros derivados. Permitir-lhes avaliar esses mesmos produtos, os riscos inerentes aos produtos financeiros bem como os factores que influenciam o seu valor.

PROGRAMA

I - OS MERCADOS – INCIDÊNCIA DOS INSTRUMENTOS FINANCEIROS

- Definições básicas, tipos de mercados, tipos de instrumentos, participantes nos mercados.

II - AS OPÇÕES. O PREÇO DOS CONTRATOS DE FUTUROS

III - ESTRATÉGIAS DE COBERTURA DO RISCO

- Conceitos, hedge ratios, estratégias e instrumentos.

IV - FUTUROS SOBRE ÍNDICES

- Características, determinação de preços e estratégias possíveis.

V - FUTUROS SOBRE TAXAS DE JURO DE CURTO PRAZO

VI - SWAPS, FRA's ENTRE OUTROS INSTRUMENTOS FINANCEIROS UTILIZADOS

- Tipos, características, determinação de preços e avaliação.

BIBLIOGRAFIA

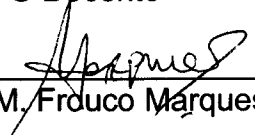
- Dubofsky, David A. (1992), *Options and Financial Futures*, McGraw-Hill International Editions.
- Edwards, R. Franklim e Ma, Cindy W. (1992), *Futures & Options*, McGraw-Hill International Editions.
- Frouco Marques, Pedro Manuel (2006), *A Análise do Risco e o Euro: Que Futuro em Portugal?*, Lisboa, Editora Universidade Lusíada.
- Levinson, Marc (2005), *Guia dos Mercados Financeiros*, Lisboa, Editora Caminho.
- Hull, John (1991), *Introduction to futures and options*, Prentice-Hall International Editions.
- Kolb, Robert, *Futures, Options & Swaps*, Ed. Blackwell, 3ª Edição.
- Peixoto, João Paulo (1997), *Futuros e Opções*, Editora McGraw-Hill.

AValiação

A avaliação dos alunos terá como base um teste que se realizará no final do período, ficando dispensados de exame final os alunos com nota igual ou superior a 10 (dez) valores.

Escola Superior de Gestão de Tomar, 18 de Fevereiro de 2008

O Docente



(Pedro M. Frouco Marques)