



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

**ESCOLA SUPERIOR DE GESTÃO DE TOMAR**

## **LICENCIATURA EM GESTÃO DE EMPRESAS**

**RAMO ORGANIZAÇÃO E GESTÃO EMPRESAS**

**NOVOS INSTRUMENTOS FINANCEIROS**

**4º ANO - 1º SEMESTRE**

**Ano Lectivo 2005/06**

REGIME SEMESTRAL

CARGA HORÁRIA – 2(T) + 2(P)

**Docente: Prof. Adjunto João Manuel Rosa Lopes**

### **OBJECTIVO:**

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

### **PROGRAMA NIF:**

#### **I INTRODUÇÃO AOS FUTUROS FINANCEIROS**

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

#### **II O PREÇO DOS CONTRATOS DE FUTUROS**

#### **III ESTRATÉGIAS DE COBERTURA DE RISCO**

Conceitos, *hedge ratios* e estratégias

#### **IV FUTUROS SOBRE ÍNDICES**

Características, determinação de preços e estratégias possíveis

#### **V FUTUROS SOBRE TAXAS DE JURO DE CURTO PRAZO**



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

## ESCOLA SUPERIOR DE GESTÃO DE TOMAR

### VI SWAPS

Tipos, características, determinação de preços e avaliação

### BIBLIOGRAFIA

- Kolb, Robert; Futures, Options & Swaps; Blackwell; (3-ª Edição).
- Dubofsky, David A.; Options and Financial Futures; Mcgraw-Hill International Editions; (1992).
- Edwards, R.Franklin e Ma, Cindy W.; Futures & Options; Mcgraw-Hill International Editions; (1992).
- Futuros e Opções; Instituto de Formação Bancária.
- Hull, John; Introduction to futures and options; Prentice-Hall International Editions; (1991).
- Peixoto, João Paulo; Futuros e Opções. McGraw-Hill. (1997).

### AVALIAÇÃO

A avaliação dos alunos será feita com base no resultado de um teste que se realizará no final do período.