

Mestrado em Auditoria e Análise Financeira

Mestrado, 2º Ciclo

Plano: Despacho n.º 10361/2016 - 17/08/2016

Ficha da Unidade Curricular: Instrumentos Financeiros de Gestão de Risco

ECTS: 5; Horas - Totais: 135.0, Contacto e Tipologia, TP:30.0;

Ano|Semestre: 1|S2; Tipo: Obrigatória; Interação: Presencial; Código: 392511

Área Científica Finanças

Docente Responsável

Pedro Miguel Azeitona Gonzaga Barroso

Prof.Adjunto Convidado

Docente e horas de contacto

Pedro Miguel Azeitona Gonzaga Barroso

Prof.Adjunto Convidado, TP: 30.0;

Objetivos de Aprendizagem

Os alunos deverão dominar conhecimentos básicos sobre os mercados e produtos derivados, de forma a conseguirem aplicar técnicas de gestão do risco financeiro. Aprender a seleccionar a melhor decisão de investimento, avaliando os produtos, técnicas e analisando os riscos inerentes e os factores que influenciam o seu valor.

Conteúdos Programáticos (resumido)

1 – Instrumentos do Mercado de Derivados

2 – Forward ou Contratos a Prazo

3 – Mercados e Contratos de Futuros

4 – Opções

5 – Estratégias com Opções em Decisões de Investimento e Especulação

6 – Swaps

7- Gestão de Risco Integrada.

Conteúdos Programáticos (detalhado)

1 – Instrumentos do Mercado de Derivados (Origem e Necessidades, Aplicações generalizadas)

2 – Forward ou Contratos a Prazo (Nomenclatura, Mercados, avaliação)

3 – Mercados e Contratos de Futuros (História, Características, Aplicações, Utilização empresarial)

4 – Opções (Tipos, Formas de Avaliação, Utilidade e aplicação)

5 – Estratégias com Opções em Decisões de Investimento e Especulação

6 – Swaps (Características e formas de calculo e avaliação)

7- Gestão de Risco Integrada (Risco Financeiro integrado no risco empresarial)

Metodologias de avaliação

A avaliação para dispensa de Exame é de 10 valores. Consiste na realização de um teste escrito (60% com consulta) e de trabalhos de grupo com apresentação e discussão na aula (40%).

Software utilizado em aula

- Processador de texto Microsoft Word
- Folha de cálculo Microsoft Excel
- Ferramentas da Web 2.0
- Sistema de Gestão de Conteúdos (Moodle) do IPT

Estágio

Não Aplicável

Bibliografia principal (máx 4 ref.)

- Brealey, R. A., Myers, S. C. e Allen, F., 2007, "Princípios de Finanças Empresariais", 8ª Ed., McGraw-Hill.
- Bodie, ZVI; Kane, A.; Marcus, A; "Investments", 10ª Ed., McGraw-Hill
- Elton, e Gruber, 2003, "Modern Portfolio Theory and Investment Analysis", Wiley and Sons.
- Hull, John C., "Options, Futures and Other Derivatives", 8ª Ed., Prentice Hall

Coerência dos conteúdos programáticos com os objetivos

A unidade curricular visa a aquisição de conhecimentos e competências para poder realizar avaliações de empresasinvestigação científica no domínio da auditoria financeira. O programa cobre os diferentes objetivos e competências específicas que se pretendem proporcionar na unidade curricular.

Metodologias de ensino

Aulas teórico-práticas. As metodologias de ensino e aprendizagem utilizadas envolvem exposições teóricas, resolução de exercícios práticos, aplicações da matéria apreendida em casos reais.

Coerência das metodologias de ensino com os objetivos

Os objetivos da unidade curricular encontram-se centrados no desenvolvimento das competências de apreensão e aplicação dos conhecimentos em situações do universo empresarial. A utilização de situações o mais realistas com problemas de gestão do dia-a-dia, justifica a coerência necessária à sua aplicação.

Língua de ensino

Português

Pré requisitos

Não aplicável

Programas Opcionais recomendados

Não Aplicável

Observações

Não Aplicável

Docente Responsável

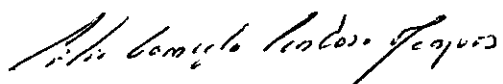
Pedro Miguel
Azeitona Gonzaga
Barroso

Digitally signed by Pedro Miguel Azeitona Gonzaga Barroso
DN: c=PT, st=Santarém, l=Tomar, o=Instituto Politécnico de Tomar, ou=Unidade Departamental de Ciências Empresariais, cn=Pedro Miguel Azeitona Gonzaga Barroso
Date: 2017.04.19 13:12:46 +01'00'

Diretor de Curso, Comissão de Curso



Conselho Técnico-Científico



Homologado pelo C.T.C.
Acta n.º 09 Data 11/5/17
