



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

Programa da Unidade Curricular
OPÇÃO 1 - MERCADOS FINANCEIROS
Ano Lectivo 2014/2015

1. Unidade Orgânica

Ciências da Economia e da Empresa (1º Ciclo)

2. Curso

Gestão de Empresa

3. Ciclo de Estudos

1º

4. Unidade Curricular

OPÇÃO 1 - MERCADOS FINANCEIROS (24154)

5. Área Científica

6. Ano curricular

3º

7. Tipo de Unidade Curricular / Semestre

1º Semestre



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

8. Tipo de aula e carga horária (tempo de trabalho)

Aulas Teóricas:	
Aulas Práticas:	
Aulas Teórico-práticas:	30,00
Orientação Tutorial:	20,00

9. Créditos

6,00

10. Coordenador da Área Científica

11. Regente

Prof. Doutor MIGUEL ALEXANDRE TEIXEIRA COELHO

12. Assistentes

13. Língua de ensino

Português

14. Objectivos Gerais

A unidade curricular foi concebida com o objectivo de proporcionar ao estudante uma formação nos seguintes domínios:

1. Avaliação de instrumentos financeiros.
2. Gestão de carteiras.
3. Gestão de risco.

15. Objectivos Específicos

1. Familiarizar os alunos com os principais instrumentos financeiros.
2. Fornecer metodologias de avaliação de instrumentos financeiros.
3. Identificar o aluno com os princípios básicos da gestão de carteira.
4. Fornecer ao aluno algumas ferramentas para cobertura de riscos.

16. Competências a adquirir

1. Decisão em contexto de incerteza.
2. Resolução de problemas complexos envolvendo a gestão de activos financeiros.
3. Proficiência na comunicação, oral e escrita, no contexto dos mercados financeiros.

17. Metodologia de ensino

O método combina a exposição teórica com a resolução de casos práticos e exercícios de simulação (com recurso a informação de mercado real), cobrindo o enquadramento, os conceitos e os modelos inerentes a cada uma das matérias a leccionar.



18. Conteúdos Programáticos

I. Introdução aos Mercados Financeiros.

II. Gestão de uma Carteira de Activos.

II.1 Relação rendibilidade/risco.

II.2 Diversificação da carteira de activos.

II.3 Carteira de variância mínima.

II.4 Fronteira de eficiência.

III. Análise e Avaliação de Instrumentos Financeiros.

III.1. Acções.

III.1.1 Caracterização do instrumento e mercado.

III.1.2 Modelos de avaliação.

III.2. Obrigações.

III.2.1 Caracterização do instrumento e mercado.

III.2.2. Medidas de performance.

III.2.3. Estrutura temporal da taxa de juro.

III.2.4 Modelos de avaliação.

III.3 Forwards

III.3.1 Caracterização do instrumento e do mercado.

III.3.2 Determinação teórica do preço.

III.4 Futuros.

III.4.1 Caracterização do instrumento e do mercado.

III.4.2 Estratégias com futuros.

III.5 Swaps.

III.5.1 Caracterização do instrumento e mercado.

III.5.2 Estratégias com swaps.

III.5.3 Determinação teórica do preço

III.6 Opções.

III.6.1 Caracterização do instrumento e mercado.

III.6.2 Estratégias com opções.

III.6.3 Determinação teórica do preço: Modelo uniforme; Modelo Binomial; Modelo Black & Scholes.

IV. Avaliação da Performance de uma Carteira de Activos.

IV.1 Modelos de avaliação: CAPM e APT.

IV.2 Outras medidas de avaliação.



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

19. Métodos de Avaliação

A avaliação contínua assenta em 3 elementos distintos, a saber:

- Participação nas aulas tutoriais.
- Elaboração de Trabalho de Grupo.
- 2 Testes facultativos.

20. Recursos Didáticos

Power Point, Internet

21. Palavras Chave

Mercados Financeiros; Gestão de Carteira; Gestão do Risco



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

23. Bibliografia Principal

Autor(es): Elton, E., Gruber, J., Stephen J. e William, N.
Título: Modern Portfolio Theory and Investment Analysis
Edição: 8ª Ano: 2010
Local: London
Editora: J. Wiley & Sons

Autor(es): Hull, J
Título: Options, Futures and Others Derivatives
Edição: 8ª Ano: 2012
Local: London
Editora: Prentice-Hall

Autor(es):
Título:
Edição: Ano:
Local:
Editora:

24. Bibliografia Complementar

Autor(es): Bennings
Título: Financial Modeling
Edição: 2ª Ano: 2000
Local: London
Editora: MIT

Autor(es): Jorion, Philippe
Título: Financial Risk Manager Handbook
Edição: 2ª Ano: 2003
Local: New Jersey
Editora: John Wiley & Sons



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

Ficha técnica MIP	
Título	Programa da unidade curricular 'OPÇÃO 1 - MERCADOS FINANCEIROS': Ano Lectivo 2014/2015
Autor	Prof. Doutor MIGUEL ALEXANDRE TEIXEIRA COELHO
Classificação	-
Descritores	-
Colaborador(es)	-
Data/Hora	05-09-2014 09:20:00
Formato de dados	Texto, PDF
Estatuto de utilização	Acesso público
Relação	Versão 1,0
(c) Universidade Lusíada de Lisboa, 2014	