



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

Programa da Unidade Curricular
OPÇÃO 1 - MERCADOS FINANCEIROS
Ano Lectivo 2019/2020

1. Unidade Orgânica

Faculdade de 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. Mercados financeiros e sua regulamentação.
2. Análise e avaliação de instrumentos financeiros.
3. Gestão de carteiras e 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 gestão/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.



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

18. Conteúdos Programáticos

I. Introdução aos Mercados Financeiros.

- I.1 Situação atual dos Mercados.
- I.2 Principais Conceitos e Riscos.
- I.3 Enquadramento Regulamentar.
- I.4 Mercados Financeiros e Disrupção tecnológica: Ameaças e Oportunidades.

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.



UNIVERSIDADE LUSÍADA DE LISBOA

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

19. Métodos de Avaliação

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

- Participação nas aulas tutoriais.
- 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): Coelho, Miguel T. e Oliveira, Rui S.
Título: Mercados: São Mesmos os Grandes Culpados das Crises?
Edição: 1ª Ano: 2015
Local: Lisboa
Editora: Bnomics

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

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 2019/2020
Autor	Prof. Doutor MIGUEL ALEXANDRE TEIXEIRA COELHO
Classificação	-
Descritores	-
Colaborador(es)	-
Data/Hora	26-07-2019 11:24:00
Formato de dados	Texto, PDF
Estatuto de utilização	Acesso público
Relação	Versão 1,0
(c) Universidade Lusíada de Lisboa, 2019	