



UNIVERSIDADE LUSÍADA
LISBOA

Programa da Unidade Curricular
TÓPICOS DE FINANÇAS

Ano Lectivo 2023/2024

1. Unidade Orgânica

Faculdade de Ciências da Economia e da Empresa

2. Curso

MESTRADO EM GESTÃO

3. Ciclo

2º

4. Unidade Curricular

TÓPICOS DE FINANÇAS (70207)

5. Área Científica

6. Ano Curricular

1º

7. Tipo de Unidade Curricular / Semestre

2º Semestre



UNIVERSIDADE LUSÍADA
LISBOA

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

Aulas Teóricas:	
Aulas Práticas:	
Aulas Teórico-Práticas:	15,00
Orientação Tutorial:	20,00

9. Créditos ECTS

7,50

10. Coordenador da Área Científica

11. Regente

Prof. Doutor MIGUEL ALEXANDRE TEIXEIRA COELHO

12. Assistentes

13. Língua de Ensino

Português

14. Objetivos Gerais

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

1. Funcionamento dos mercados financeiros.
2. Análise e avaliação de instrumentos financeiros.
3. Identificação, caracterização, medição e gestão de riscos financeiros.

15. Objetivos Específicos

1. Familiarizar o aluno com os princípios gerais do cálculo financeiro.
2. Familiarizar o aluno com os princípios gerais de funcionamento dos mercados financeiros.
3. Familiarizar os alunos com os principais instrumentos financeiros.
4. Fornecer metodologias de avaliação de instrumentos financeiros.
5. Identificar o aluno com os princípios básicos para a identificação, caracterização e medição de riscos financeiros.
6. Fornecer ao aluno algumas ferramentas para gestão/cobertura de riscos fi

16. Competências a adquirir

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



UNIVERSIDADE LUSÍADA
LISBOA

17. Metodologia de Ensino

O método combina a exposição teórica (saber-saber) com a resolução de casos práticos e exercícios de simulação (saber - fazer), cobrindo o enquadramento, os conceitos e os modelos inerentes a cada uma das matérias a lecionar. Procura-se ainda discutir a conciliação entre conhecimentos teóricos e conhecimentos práticos em contextos reais, assegurando desta forma uma perspetiva phronetica (sabedoria) do tema.

18. Conteúdos Programáticos

I. Introdução.

I.1 Princípios gerais do Cálculo Financeiro.

I.2 Situação atual dos Mercados

I.3 Principais Conceitos e Riscos.

I.4 Enquadramento Regulamentar dos Mercados Financeiros.

I.5 Mercados Financeiros, Disrupção Tecnológica e Sustentabilidade: Ameaças e Oportunidades.

II. Análise e Avaliação dos Principais Instrumentos Financeiros.

II.1. Ações: Caracterização do instrumento e modelos de avaliação.

II.2. Obrigações: Caracterização do instrumento, medidas de performance modelos de avaliação.

II.3 Forwards: Caracterização do instrumento e modelos de avaliação.

II.4 Futuros: Caracterização do instrumento e modelos de avaliação.

II.5 Swaps: Caracterização do instrumento e modelos de avaliação.

II.6 Opções: Caracterização do instrumento e determinação teórica do preço.

III. Princípios Básicos na Gestão do Risco.

III.1 Processo de Decisão em Contexto de Incerteza: Uma Aplicação à Gestão de Risco

III.2 Relação Rendibilidade-Risco.

IV. Identificação, Caracterização, Medição e Gestão dos Principais Riscos Financeiros.

IV.1. Introdução.

IV.2. Risco Liquidez.

IV.3. Risco de Mercado.

IV.4. Risco de Crédito.

19. Métodos de Avaliação

A avaliação contínua assenta na realização de 2 Testes.

20. Recursos Didáticos

Bibliografia adotada

Power Point

Videos

Internet



UNIVERSIDADE LUSÍADA
LISBOA

21. Objetivos de Sustentabilidade

As finanças sustentáveis correspondem ao novo paradigma de finanças de reorientação dos fluxos financeiros para os investimentos sustentáveis considerando, nomeadamente, aspetos Ambientais, Sociais e de Governance (ESG).

Neste contexto, a unidade curricular procura sensibilizar os alunos para a necessidade de assegurar princípios financeiros sustentáveis, entendidos como finanças destinadas a apoiar o crescimento económico, reduzindo simultaneamente as pressões sobre o ambiente e tendo em conta

22. Palavras Chave

Mercados Financeiros; Instrumentos Financeiros; Gestão de Riscos



UNIVERSIDADE LUSÍADA
LISBOA

23. Bibliografia Principal

Autor(es): Hull, J.
Título: Options, Futures, and Other Derivatives (9th Edition)
Edição: 9th Edition Ano:
Local:
Editora: John Wiley

Autor(es): Edwin J. Elton, Martin J. Gruber, Stephen J. Brown, William N. Goetzmann
Título: Modern Portfolio Theory and Investment Analysis
Edição: 9th Edition Ano: 2014
Local:
Editora: Wiley Custom

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

24. Bibliografia Complementar

Autor(es): Coelho, Miguel T. e Oliveira, Rui
Título: Mercados: São Mesmo os Grandes Culpados das Crises?
Edição: 1.^a Ano: 2015
Local: Lisboa
Editora: Bnomics

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



UNIVERSIDADE LUSÍADA
LISBOA

Ficha técnica MIP / MIP Datasheet	
Título / Title	Programa da unidade curricular 'TÓPICOS DE FINANÇAS': Ano Lectivo 2023/2024
Autor / Author	Prof. Doutor MIGUEL ALEXANDRE TEIXEIRA COELHO
Classificação / Classification	-
Descritores / Descriptors	-
Colaborador(es) / Colaborator(s)	-
Data Hora / Date Time	11-12-2023 09:57:00
Formato de dados / Data Format	Texto / Text, PDF
Estatuto de utilização / Usage	Acesso público / Public Access
Relação / Relation	Versão 2,0
(c) Universidade Lusíada, 2024	