
Ano Letivo 2018-19

Unidade Curricular INVESTIMENTOS FINANCEIROS

Cursos FINANÇAS EMPRESARIAIS (2.º Ciclo)

Unidade Orgânica Faculdade de Economia

Código da Unidade Curricular 15541005

Área Científica FINANÇAS

Sigla

Línguas de Aprendizagem Português

Modalidade de ensino Presencial

Docente Responsável «INFORMAÇÃO NÃO DISPONIVEL»

DOCENTE	TIPO DE AULA	TURMAS	TOTAL HORAS DE CONTACTO (*)
---------	--------------	--------	-----------------------------

* Para turmas lecionadas conjuntamente, apenas é contabilizada a carga horária de uma delas.

ANO	PERÍODO DE FUNCIONAMENTO*	HORAS DE CONTACTO	HORAS TOTAIS DE TRABALHO	ECTS
1º	Q2	12T; 12TP; 24OT; 3O	210	7,5

* A-Anual;S-Semestral;Q-Quadrimestral;T-Trimestral

Precedências

Sem precedências

Conhecimentos Prévios recomendados

Cálculo e Gestão Financeira, Matemática, Estatística

Objetivos de aprendizagem (conhecimentos, aptidões e competências)

- . Compreender as principais características das obrigações
- . Discutir os principais métodos de avaliação da rentabilidade e risco das obrigações
- . Compreender as principais características das acções ordinárias
- . Discutir as diversas formas de selecção de acções ordinárias
- . Identificar contratos forward e contratos de futuros, descrevendo as suas especificidades e principais diferenças
- . Compreender as operações de cobertura de risco com utilização de forward rate agreements e de contratos de futuros
- . Caracterizar as opções e os seus principais modelos de avaliação
- . Desenvolver as principais estratégias de cobertura de risco e de investimento com utilização de opções
- . Explicitar os principais conceitos e características dos swaps

Conteúdos programáticos

1. Mercados e Investimentos Financeiros - Enquadramento
2. Risco e Rendibilidade
3. Obrigações
4. Acções
5. Futuros e forwards
6. Caracterização e funcionamento das Opções
7. Caracterização dos Swaps

Metodologias de ensino (avaliação incluída)

A componente letiva da unidade curricular estrutura-se da seguinte forma:
Aulas Teóricas (12 horas); Teórico-práticas (12 horas); Orientação Tutorial (24horas); Outras (3 horas)

Avaliação: Uma prova individual escrita com a ponderação de 100%.

Bibliografia principal

- . Jones, C., Investments, Wiley, 11th Edition
- . Mayes, T., Shank, T., Financial Analysis with Microsoft Excel, South-Western ? Cengage Learning, 5th Edition
- . Mishkin, F., Eakins, S., Financial Markets and Institutions, Pearson, 6th Edition
- . Hull, J., Options, Futures and Other Derivatives, McGraw-Hill, 8th Edition
- . Hull, J., Fundamentals of futures and options market, Prentice-Hall, 7th Edition.
- . Bodie, Z., Kane, A. and A. Marcus, Investments, McGraw-Hill, 9th Edition

Academic Year 2018-19

Course unit FINANCIAL INVESTMENTS

Courses FINANCE

Faculty / School Faculdade de Economia

Main Scientific Area FINANÇAS

Acronym

Language of instruction Portuguese

Teaching/Learning modality Students are required to physically attend classes

Coordinating teacher «INFORMAÇÃO NÃO DISPONIVEL»

Teaching staff	Type	Classes	Hours (*)
----------------	------	---------	-----------

* For classes taught jointly, it is only accounted the workload of one.

Contact hours

T	TP	PL	TC	S	E	OT	O	Total
12	12	0	0	0	0	24	3	210

T - Theoretical; TP - Theoretical and practical ; PL - Practical and laboratorial; TC - Field Work; S - Seminar; E - Training; OT - Tutorial; O - Other

Pre-requisites

no pre-requisites

Prior knowledge and skills

Maths, Stats and Financial Management

The students intended learning outcomes (knowledge, skills and competences)

- . Understand the basic characteristics of bonds
- . Discuss the main methods for assess the risk/return characteristics of bonds
- . Understand the basic characteristics of stocks
- . Discuss the main methods for stock picking
- . Identify forward and futures and discuss their similarities and differences
- . Discuss how to hedge interest rate risk using FRAs and futures
- . Understand the characteristics of options and their basic valuation models
- . Discuss how to hedge using options
- . Discuss the main characteristics of Swaps and how to price them

Syllabus

1. Financial Markets: an overview
2. Risk and Return
3. Bonds
4. Stocks
5. Futures and forwards
6. Options
7. Swaps

Teaching methodologies (including evaluation)

Class work is as follows:

Lectures/tutorials (24 hours); Tutorial work (24 hours); Other (3 hours)

Assessment: Final written exam (weight of 100%).

Main Bibliography

- . Jones, C., Investments, Wiley, 11th Edition
- . Mayes, T., Shank, T., Financial Analysis with Microsoft Excel, South-Western ? Cengage Learning, 5th Edition
- . Mishkin, F., Eakins, S., Financial Markets and Institutions, Pearson, 6th Edition
- . Hull, J., Options, Futures and Other Derivatives, McGraw-Hill, 8th Edition
- . Hull, J., Fundamentals of futures and options market, Prentice-Hall, 7th Edition.
- . Bodie, Z., Kane, A. and A. Marcus, Investments, McGraw-Hill, 9th Edition