
Ano Letivo 2017-18

Unidade Curricular DERIVADOS FINANCEIROS

Cursos ECONOMIA FINANCEIRA (2.º ciclo) (*)

(*) Curso onde a unidade curricular é opcional

Unidade Orgânica Faculdade de Economia

Código da Unidade Curricular 17911008

Área Científica GESTÃO

Sigla

Línguas de Aprendizagem Inglês - EN.

Modalidade de ensino Presencial.

Docente Responsável «INFORMAÇÃO NÃO DISPONÍVEL»

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	S2	30TP; 12OT	168	6

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

Precedências

Sem precedências

Conhecimentos Prévios recomendados

Conhecimentos em matemática financeira.

Objetivos de aprendizagem (conhecimentos, aptidões e competências)

Após a aprovação nesta unidade curricular, o aluno deverá ser capaz de:

- Dominar os conceitos fundamentais dos principais produtos de derivados;
- Determinar o preço de cada produto derivado;
- Explicar a relação entre preços e arbitragem;
- Saber utilizar cada derivado numa perspectiva de especulação e de gestão de riscos.

Conteúdos programáticos

1. Introdução aos produtos derivados
2. Contratos forward
3. Futuros
4. Swaps
5. Opções
6. Produtos derivados e inovação financeira

Metodologias de ensino (avaliação incluída)

Esta unidade curricular é lecionada com base em sessões teórico-práticas que servem para expor os pontos do programa apresentados anteriormente e para a realização de um conjunto de exercícios para a consolidação de conhecimentos.

A avaliação de conhecimentos comporta duas componentes:

- Avaliação contínua (casos e exercícios): 40%;
- Avaliação através de uma prova individual escrita: 60%.

Bibliografia principal

Chance, D. M. & Brooks, R. (2008). An Introduction to Derivatives and Risk Management, 7th Edition, Thompson South-Western Publishers.

Hull, J. (2012), Options, Futures and Other Derivatives, Eighth Edition, Pearson.

Wilmott, P., Howison, S. & Dewynne, J. (2002), The Mathematics of Financial Derivatives: A Student Introduction, Cambridge University Press.

Academic Year 2017-18

Course unit DERIVADOS FINANCEIROS

Courses FINANCIAL ECONOMICS (*)

(*) Optional course unit for this course

Faculty / School Faculdade de Economia

Main Scientific Area GESTÃO

Acronym

Language of instruction English - EN.

Teaching/Learning modality In class.

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
0	30	0	0	0	0	12	0	168

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

Knowledge in financial mathematics.

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

After attending the course, the students are expected:

- To identify and understand the derivative portfolio;
- To compute the price of each derivative;
- To explain the relationship between pricing and arbitrage;
- To use each derivative as a speculative and risk management tool.

Syllabus

1. Introduction to derivatives
2. Forwards contracts
3. Futures
4. Swaps
5. Options
6. Derivatives and financial innovation

Teaching methodologies (including evaluation)

Sessions of this course are based on lectures/tutorials to present the topics of the syllabus. The main theoretical aspects are presented to students for each section so they are able to discuss applied problems with critical view and work out problems and questions in this area.

The assessment of this course is based on two components:

- Coursework essays (case studies and problems): 40%;
- Individual exam: 60%.

Main Bibliography

Chance, D. M. & Brooks, R. (2008). An Introduction to Derivatives and Risk Management, 7th Edition, Thompson South-Western Publishers.

Hull, J. (2012), Options, Futures and Other Derivatives, Eighth Edition, Pearson.

Wilmott, P., Howison, S. & Dewynne, J. (2002), The Mathematics of Financial Derivatives: A Student Introduction, Cambridge University Press.