



INSTITUTO POLITÉCNICO DE TOMAR

ESCOLA SUPERIOR DE GESTÃO DE TOMAR

CURSO

Gestão e Administração Bancária

ANO LECTIVO

2012/2013

FICHA DA UNIDADE CURRICULAR

Unidade Curricular

Análise de Risco

Área Científica

Financeiras

Classificação curricular

Obrigatória

Ano / Semestre

3º/2º

Créditos	Horas de trabalho do aluno	Carga horária das sessões de ensino	
		Natureza Colectiva (NC)	Orientação Tutorial (OT)
5	135	T30 + P30	

DOCENTES		CATEGORIA
Responsável	Ricardo Covas	Professor Adjunto
Teóricas		
Teórico-Práticas	Ricardo Covas	Professor Adjunto
Prático-Laboratorial		

OBJECTIVOS

Introduzir-se-á a Gestão de Risco sob um ponto de vista de mercados financeiros, abordando os seus fundamentos e conceitos mais usuais. Pretende-se também apresentar as ferramentas essenciais ao apreçamento de opções, de análise e de gestão de risco financeiro decorrente da tomada de posições em mercado. A introdução a esta matéria é feita sob um ponto de vista muito prático, manuseando-se os modelos e conceitos mais comuns na literatura que coincidem com *standards* de salas de mercado.

Pretende-se que o aluno aprenda um conjunto de regras que auxiliam o *trader* (ou o responsável pelo controlo de exposição ao risco) a lidar com incerteza e risco, através da identificação de riscos e cobertura desses riscos pela tomada de posições em mercado financeiro.

PROGRAMA PREVISTO

Cap. I – Mercados Financeiros

- 1.1 – Mercados e matemática
- 1.2 – Acções, derivados e subjacentes
- 1.3 – Opções Europeias e Americanas (call vs. put)
- 1.4 – Posições em mercado

