

### Caraterização da Unidade Curricular / Characterisation of the Curricular Unit

<b>Designação da Unidade Curricular / Curricular Unit:</b>	[3182992] Mercados e Investimentos Financeiros [3182992] Financial Markets and Investments		
<b>Plano / Plan:</b>	Mestrado em Finanças Empresariais V4		
<b>Curso / Course:</b>	Mestrado em Finanças Empresariais Corporate Finance		
<b>Grau / Diploma:</b>	Mestre		
<b>Departamento / Department:</b>	Departamento de Gestão		
<b>Unidade Orgânica / Organic Unit:</b>	Escola Superior de Tecnologia e Gestão de Viseu		
<b>Área Científica / Scientific Area:</b>	Disciplina da Pós-Graduação (Curricular), Finanças		
<b>Ano Curricular / Curricular Year:</b>	1		
<b>Período / Term:</b>	S1		
<b>ECTS:</b>	6		
<b>Horas de Trabalho / Work Hours:</b>	0159:00		
<b>Horas de Contacto/Contact Hours:</b>			
(T) Teóricas/Theoretical:	0000:00	(TC) Trabalho de Campo/Fieldwork:	0000:00
(TP) Teórico-Práticas/Theoretical-Practical:	0039:00	(OT) Orientação Tutorial/Tutorial Orientation:	0000:00
(P) Práticas/Practical:	0000:00	(E) Estágio/Internship:	0000:00
(PL) Práticas Laboratoriais/Practical Labs:	0000:00	(O) Outras/Others:	0000:00
(S) Seminário/Seminar:	0000:00		

### Docente Responsável / Responsible Teaching

[3329] Pedro Manuel Nogueira Reis

### Docentes que lecionam / Teaching staff

[3329] PEDRO MANUEL NOGUEIRA REIS

### **Objetivos de Aprendizagem**

Esta unidade curricular visa dotar o aluno de um conhecimento geral e amplo dos vários mercados financeiros e das suas interligações, bem como dos agentes que neles atuam e das estratégias que seguem.

A exposição dos modelos teóricos de avaliação de vários tipos de investimento financeiros será complementada com a apresentação de produtos financeiros com exemplos aplicados ao contexto financeiro português ou de atualidade económica.

### **Learning Outcomes of the Curricular Unit**

This course aims to provide the student with a general and broad knowledge of the various financial markets and their interconnections, and the agents who work in them and the strategies they follow.

The exposure of theoretical models of evaluation of various types of financial investment will be complemented by the presentation of financial products with examples applied to the Portuguese financial and economic context.

### **Conteudos Programáticos (Lim:1000)**

Esta unidade curricular visa dotar o aluno de um conhecimento geral e amplo dos vários mercados financeiros e das suas interligações, bem como dos agentes que neles atuam e das estratégias que seguem.

A exposição dos modelos teóricos de avaliação de vários tipos de investimento financeiros será complementada com a apresentação de produtos financeiros com exemplos aplicados ao contexto financeiro português ou de atualidade económica.

I - O Sistema Financeiro, Mercados Monetários; mercados financeiros;

- Organização e funcionamento do mercado financeiro

II - O Investimento Financeiro e Risco de Mercado

- O mercado acionista

III - O mercado obrigacionista e o risco de Taxa de Juro

- Mercado e avaliação de obrigações

IV - Imunização do risco de taxa de juro

- Medidas de risco de taxa de juro:

### **Syllabus (Lim:1000)**

- I - The Financial System - Monetary Markets ; Financial markets;
  - Organization and functioning of the financial market
- II - The Financial Investment and Market Risk
  - The equity market
- III - The bond market and the risk of interest rate
  - Market and bond assessment
- IV - Immunization risk of interest rate
  - Interest rate risk measures:

### **Metodologias de Ensino (Avaliação incluída; Lim:1000)**

A avaliação de conhecimentos reveste a modalidade de i) Trabalho e Exame normal e/ou ii) Exame de recurso. Os alunos que optarem por avaliação na forma de avaliação i) anterior deverão organizar-se em grupos máximos de 4 pessoas para realizar o referido Trabalho escrito.

Na forma de avaliação i) os alunos deverão realizar ainda o Exame Normal. O Trabalho e o exame normal, concorrem para a nota final com as ponderações de 40% (Trabalho), 60% (para o Exame Normal). A aprovação far-se-á com 10 valores (intervalo 0-20) de nota global mínima, mas os alunos têm ainda que obter uma nota mínima de 9 valores quer no Trabalho quer no Exame normal. Neste caso a nota final será a referida média ponderada.

Caso não se tenha submetido a avaliação da modalidade i), o aluno poderá efetuar o Exame recurso (modalidade ii) que, neste caso, definirá em 100% a avaliação final do aluno.

### **Teaching Methodologies (Including evaluation; Lim:1000)**

The assessment takes the form of frequency and/or final exam. Students who choose to an evaluation in frequency regime should be organized in groups of a maximum of 4 to make a written work, dealing with the subject (to be defined).

These students should still perform a theoretical and practical test at the end of the school activities. The two tests provided for in frequency for evaluation contribute to the final grade with weightings of 40% (work), 60% (frequency test). The approval shall be achieved with 10 (range 0-20) minimum overall grade, but students still have to get a minimum score of 9 points in these two stages of evaluation (work and by frequency test). In this case, the final score is the said weighted average.

If you do not undergo evaluation by frequency, the student can still make a final written exam that will set at 100% the final evaluation of the student.

### **Bibliografia de Consulta (Lim:1000)**

Brealey, R.; Myers, S., e M. Allen; Princípios de Finanças Empresariais, 8ª edição, McGraw-Hill, 2008. Quota 658.15BRE. Registo 012265.

Pires, Cesaltina; Mercados e Investimentos Financeiros, 3º Edição, Escolar Editora, 2006. Quota 336.76 PIR. Registo 011103.

Ross, S. A., Westerfield, R. W. & Jaffee, J. F. Corporate Finance, 7th Ed., Irwin/McGraw-Hill, 2006. Quota 658.15 RoSS. Registo 010058.

Vieito, João P. e Maqueira, Carlos P. (2013). Finanças Empresariais, Escolar editora, 2ª edição.

Afonso, António; Borges, Maria R.; Calado João e Garcia, Maria T. (2016). Economia Financeira, 2ª edição, Escolar Editora.

Fernandes, A.; Mota, P.; Alves, C. e Rocha, M. (2015). Mercados, Produtos e Valorimetria de Produtos Financeiros, 2ª Ed., Almedina.

**Garcia, Maria Teresa Medeiros (2020). Economia financeira. Exercícios resolvidos e propostos. Escolar Editora**

### **Bibliography (Lim:1000)**

Brealey, R.; Myers, S., e M. Allen; Princípios de Finanças Empresariais, 8ª edição, McGraw-Hill, 2008. Quota 658.15BRE. Registo 012265.

Pires, Cesaltina; Mercados e Investimentos Financeiros, 3º Edição, Escolar Editora, 2006. Quota 336.76 PIR. Registo 011103.

Ross, S. A., Westerfield, R. W. & Jaffee, J. F. Corporate Finance, 7th Ed., Irwin/McGraw-Hill, 2006. Quota 658.15 RoSS. Registo 010058.

Vieito, João P. e Maqueira, Carlos P. (2013). Finanças Empresariais, Escolar editora, 2ª edição.

Afonso, António; Borges, Maria R.; Calado João e Garcia, Maria T. (2016). Economia Financeira, 2ª edição, Escolar Editora.

Fernandes, A.; Mota, P.; Alves, C. e Rocha, M. (2015). Mercados, Produtos e Valorimetria de Produtos Financeiros, 2ª Ed., Almedina.

**Garcia, Maria Teresa Medeiros (2020). Economia financeira. Exercícios resolvidos e propostos. Escolar Editora**

**Observações**

«Observações»

**Observations**

«Observations»

**Observações complementares**