

## FICHA DA UNIDADE CURRICULAR

### IDENTIFICAÇÃO / IDENTIFICATION

|                           |                      |                |   |
|---------------------------|----------------------|----------------|---|
| <b>UNIDADE CURRICULAR</b> | Mercados Financeiros |                |   |
| <b>CICLO DE ESTUDO</b>    | Licenciatura         | <b>Nº ECTS</b> | 6 |

### OBJETIVOS DE APRENDIZAGEM / LEARNING OUTCOMES OF THE CURRICULAR UNIT

#### CONHECIMENTOS APROFUNDADOS:

- Análise de mercados financeiros
- Análise de investimentos financeiros

#### APTIDÕES AVANÇADAS:

- Recolher, selecionar e interpretar a informação financeira relevante, construindo e fundamentando a sua própria argumentação
- Aplicar de forma crítica conhecimentos de mercados financeiros em contexto empresarial, assumindo a responsabilidade das suas decisões
- Resolução de problemas complexos e imprevisíveis na gestão de títulos de rendimento fixo e variável
- Continuar a sua evolução profissional e pessoal nos mercados financeiros, adquirindo princípios de aprendizagem ao longo da vida com elevada autonomia
- Cultura de investigação na área nos mercados financeiros e da gestão de carteiras

#### COMPETÊNCIAS:

- Efetuar análises de projetos de investimento
- Tomar as melhores decisões no âmbito da gestão de investimentos em mercados financeiros
- Analisar os mercados financeiros
- Analisar a sensibilidade dos mercados financeiros a determinadas variáveis

### CONTEUDOS PROGRAMÁTICOS / SYLLABUS

- 1.Mercado de capitais
- 2.Teorias da carteira e modelos de equilíbrio  
Teorias da Carteira  
Capital Asset Pricing Model (CAPM)
- 3.Títulos de rendimento fixo  
Tipologia e Características das Obrigações  
Estrutura temporal de taxas de juro.  
Avaliação e Preço de Obrigações e Indicadores de Rendimento  
Medidas de Risco às Taxas de Juro  
Estratégias de Gestão de Carteiras de Obrigações
4. Títulos de rendimento variável  
Tipologia e Características das Acções  
Avaliação de Acções pelos Dividendos

### DEMONSTRAÇÃO DA COERÊNCIA DOS CONTEUDOS PROGRAMÁTICOS COM OS OBJETIVOS DA UNIDADE CURRICULAR / DEMONSTRATION OF THE SYLLABUS COHERENCE WITH THE CURRICULAR UNIT'S OBJECTIVES

O CAPÍTULO 1, 2, 3 e 4 permitem que o estudante obtenha conhecimentos para conhecer em detalhe os mercados financeiros, fornecem as ferramentas essenciais para uma correta e assertiva análise aos títulos financeiros e dotam o aluno de um espírito crítico e capacidade de tomada de decisões.

O CAPÍTULO 2, 3 e 4, fornecem aos alunos as ferramentas para que o mesmo seja capaz de analisar e gerir carteiras de títulos, de forma autónoma e tomarem as decisões mais assertivas para a performance dos investimentos financeiros realizados.

No final, o estudante será capaz de analisar os mercados financeiros e -tomar as melhores decisões no âmbito da gestão de investimentos.

O carácter aplicado da disciplina prepara o Estudante para recolher, seleccionar e interpretar a informação financeira relevante e para aplicar de forma crítica conhecimentos de mercados financeiros na resolução de problemas complexos e imprevisíveis em contexto empresarial.

#### **MÉTODO DE ENSINO (AVALIAÇÃO INCLUIDA) / TEACHING METHODOLOGIES (INCLUDING EVALUATION)**

As metodologias de ensino mobilizadas contemplarão distintas estratégias de modo a que todos os conteúdos programáticos sejam abordados em aulas teórico-práticas:

- i. Autoestudo de aprofundamento das matérias das sessões teóricas
- ii. Pesquisas bibliográficas no autoestudo e para a resolução dos casos
- iii. Discussões em aula, sobre os casos e as temáticas apresentadas
- iv. Aprendizagem por experimentação/desafios
- v. Aprendizagem baseada em casos, como forma de aplicar os conhecimentos e compreender a realidade empresarial
- vi. Relatórios sintetizadoras dos casos, fomentando a compreensão crítica de teorias e princípios
- vii. Trabalhos de equipa e troca de experiências para desenvolver os casos e nas discussões
- viii. Contacto com meio empresarial para a resolução dos casos

#### **DEMONSTRAÇÃO DA COERÊNCIA DAS METODOLOGIAS DE ENSINO COM OS OBJETIVOS DE APRENDIZAGEM DA UNIDADE CURRICULAR / DEMONSTRATION OF THE COHERENCE BETWEEN THE TEACHING METHODOLOGIES AND THE LEARNING OUTCOMES**

A APRENDIZAGEM BASEADA EM CASOS é fundamental no processo de obtenção de conhecimentos na área da gestão e para a desenvolver a capacidade de desenvolver soluções ou emitir juízos em situações de informação limitada ou incompleta, incluindo reflexões sobre as implicações e responsabilidades éticas e sociais.

O AUTOESTUDO e as PESQUISAS BIBLIOGRÁFICAS preparam o aluno para efetuar investigações em autonomia.

Os RELATÓRIOS preparam o aluno para ter capacidade de recolher, seleccionar e interpretar a informação financeira relevante, e analisar os dados necessários para executar as suas tarefas na área dos investimentos em mercados financeiros.

O CONTACTO COM MEIO EMPRESARIAL apoiam o aluno na compreensão das finanças e nos propósitos que levam às mesmas. Permite ainda melhorar a sensibilidade do aluno no que toca à análise dos títulos das empresas.

As DISCUSSÕES EM AULA e os TRABALHOS DE EQUIPA e TROCA DE EXPERIÊNCIAS ajudam o aluno a desenvolver a capacidade de resolução de problemas em situações novas e não familiares, em contextos alargados e multidisciplinares, a preparar-se para a aplicação da investimentos financeiros e gestão de carteiras, bem como da análise de informação necessária para a tomada de decisões e aplicação dos melhores investimentos financeiros.

As discussões em aula e os trabalhos de equipa desenvolvem ainda a capacidade para integrar conhecimentos e lidar com questões complexas, ajudando-o a saber construir e fundamentar a sua própria argumentação.

A METODOLOGIA DE AVALIAÇÃO apoia de uma forma geral todos os objetivos de aprendizagem, sobretudo ao nível do estudante aprender a aplicar de forma crítica conhecimentos de mercados financeiros em contexto empresarial, assumindo a responsabilidade das suas decisões e ter capacidade para a resolução de problemas complexos e imprevisíveis de mercados financeiros.

#### **BIBLIOGRAFIA RECOMENDADA / RECOMMENDED BIBLIOGRAPHY**

- Batista, A. (2020): Matemática Financeira - O valor do dinheiro ao longo do tempo (3ª Edição). Porto: Vida Económica
- Bastos, C. (2018). Finanças empresariais da teoria à prática. Lisboa: Edições Sílabo
- Brandão, E. (2014). Finanças. (8 ed.). Lisboa: Publidisa
- Brealey, R., Allen, F. & Myers, S. C. (2019). Principles of Corporate Finance. (13 ed.). Nova Iorque: McGraw-Hill
- Lobão, J. (2020): Finanças comportamentais. São Paulo: Actual Editora
- Levi, M. (2018). International Finance. (6 ed.). Nova Jersey: Wiley-Blackwell
- Brigham, E. F. & Daves, P. R.(2018). Intermediate Financial Management. (13 ed.). Boston: Cengage Learning
- Pinho, C. & Soares, I. (2018). Finanças, Mercados e Instrumentos. (3 ed.). Lisboa: Edições Sílabo
- Silva, M. (2019). Bolsa - Investir nos mercados financeiros. (7 ed.). Lisboa: Bookout
- <https://www.euronext.com/pt-pt>
- <https://www.nber.org/papersbyprog/IFM.html>
- [http://www.academia.edu/Documents/in/International\\_Finance](http://www.academia.edu/Documents/in/International_Finance)
- <https://ideas.repec.org/s/fip/fedgif.html>