

## 1. Caracterização da Unidade Curricular

### 1.1. Designação da Unidade Curricular

#### 1.1.1. Designação

---

Investimentos Financeiros: Mercados à vista e a Prazo

Curso(s):

Mestrado em Contabilidade

#### 1.1.2. *Designation*

---

Financial Investments, Spot and Forward Markets

Course(s):

### 1.2. Sigla da área científica em que se insere

#### 1.2.1. Sigla da área científica

---

FE

#### 1.2.2. *Scientific area's acronym*

---

FE

### 1.3. Duração da Unidade Curricular

#### 1.3.1. Duração

---

Semestral

#### 1.3.2. *Duration*

---

Semestral

### 1.4. Total de horas de trabalho

#### 1.4.1. Horas de trabalho

---

Horas de Trabalho: 0162:00

#### 1.4.2. *Working hours*

---

Working hours: 0162:00

**1.5. Total de horas de contacto**

**1.5.1. Horas de contacto**

---

(T) Teóricas:	0000:00	(TC) Trabalho de Campo:	0000:00
(TP) Teórico-Práticas:	0030:00	(OT) Orientação Tutorial:	0020:00
(P) Práticas:	0000:00	(E) Estágio:	0000:00
(PL) Práticas Laboratoriais:	0000:00	(O) Outras:	0015:00
(S) Seminário:	0000:00		
Horas Contacto:	0065:00		

**1.5.2. Contact hours**

---

(T) Theoretical:	0000:00	(TC) Field Work:	0000:00
(TP) Theoretical-practical:	0030:00	(OT) Tutorial Guidance:	0020:00
(P) Practical:	0000:00	(E) Internship:	0000:00
(PL) Laboratory practices:	0000:00	(O) Other:	0015:00
(S) Seminar:	0000:00		
Contact Hours:	0065:00		

**1.6. ECTS**

6

**1.7. Observações**

**1.7.1. Observações**

Obrigatória

**1.7.2. Comments**

Mandatory

**2. Docente responsável e respetiva carga letiva na Unidade Curricular**

**2.1. Docente responsável e carga letiva (preencher o nome completo)**

**SÓNIA MARGARIDA RICARDO BENTES**

TPMCN11 (2 horas semanais; 30 horas semestrais)

**2.2. Responsible academic staff member and lecturing load (fill in the full name)**

**SÓNIA MARGARIDA RICARDO BENTES**

TPMCN11 (2 week hours; 30 semester hours)

### 3. Outros docentes e respetivas cargas letivas na Unidade Curricular

#### 3.1. Outros docentes e respetivas carga letivas

---

#### 3.2. *Other academic staff and lecturing load*

---

### 4. Objetivos de aprendizagem (conhecimentos, aptidões e competências a desenvolver pelos estudantes)

#### 4.1. Objetivos de aprendizagem

---

Proporcionar uma visão global e integrada dos mercados financeiros.

#### 4.2. *Learning outcomes of the curricular unit*

---

To enable a comprehensive vision of the financial markets.

### 5. Conteúdos programáticos

#### 5.1. Conteúdos

---

1. Introdução aos mercados financeiros
2. Conceito de volatilidade no contexto dos mercados financeiros
  - 2.1 Volatilidade histórica e implícita
  - 2.2 Principais fatos estilizados do comportamento da volatilidade
  - 2.3 Principais modelos de volatilidade condicionada
3. Caracterização, funcionamento e principais estratégias no mercado de obrigações
4. Caracterização dos principais instrumentos financeiros derivados

#### 5.2. *Syllabus*

---

1. Introduction to financial markets
2. Stock market volatility
- 3 Bond markets
4. Financial derivatives

## 6. Demonstração da coerência dos conteúdos programáticos com os objetivos da Unidade Curricular

### 6.1. Demonstração da coerência dos conteúdos programáticos

---

Os conteúdos programáticos encontram-se de acordo com o objetivo geral da unidade curricular.

### 6.2. *Demonstration of the syllabus coherence with the curricular unit's objectives*

---

The syllabus contents meets the curricular unit's objectives.

## 7. Metodologias de ensino (avaliação incluída)

### 7.1. Metodologias de ensino (avaliação incluída)

---

Aulas teórico-práticas e expositivas.

*Avaliação Contínua:*

**Trabalho:** Classificação de 0 a 20 valores (ponderação: 50%)

**Exame Final:** Classificação de 0 a 20 valores (ponderação: 50%)

#### **Trabalho:**

Relatório (com um máximo de 10 páginas) de análise crítica de um artigo científico na área de finanças e contabilidade, publicado na literatura (ver revistas em anexo), e escolhido pelo aluno.

O relatório deve identificar, entre outros:

- O propósito do estudo e os gaps existentes na Literatura;
- As *research questions* colocadas pelos autores;
- O enquadramento teórico e a revisão da Literatura;
- A metodologia seguida pelos investigadores (fontes de informação, técnicas quantitativas e qualitativas utilizadas);
- Principais contribuições para o desenvolvimento científico da área de finanças e contabilidade;
- Limitações da investigação desenvolvida;

Sugestões para investigação futura.

## 7.2. *Teaching methodologies (including evaluation)*

---

Theoretical and practical lessons.

Evaluation: 50% test; 50% home work.

## 8. Demonstração da coerência das metodologias de ensino com os objetivos de aprendizagem da Unidade Curricular

### 8.1. Demonstração da coerência das metodologias

---

As metodologias de ensino foram elaboradas de acordo com os objetivos definidos para a unidade curricular.

### 8.2. *Demonstration of the coherence between the teaching methodologies and the learning outcomes*

---

The teaching methodologies were developed according to meet the learning outcomes.

## 9. Bibliografia de consulta/existência obrigatória

---

Bentes, S.R. (2011) *Sobre a Medição da Volatilidade nos Mercados Bolsistas Internacionais: Evidência dos Países do G7*, Edições Colibri, Coleção Caminhos do Conhecimento ¿ Contabilidade e Gestão.

Ferreira, D. (2008) *Opções Financeiras ¿ Gestão de Risco, Especulação e Arbitragem* ¿ Edições Sílabo.

Ferreira, D. (2008) *Swaps e Derivados de Crédito*, Edições Sílabo.

Hull, J.C. (2011) *Options, Futures and Other Derivatives*, 8<sup>th</sup> edition, Prentice-Hall.

Soares, I. e C. Pinho (2008) *Finanças ¿ Mercados e Instrumentos*, 2<sup>a</sup> Edição, Edições Sílabo.