

1. Caracterização da Unidade Curricular

1.1. Designação da Unidade Curricular

1.1.1. Designação

Mercado e Produtos Financeiros

Curso(s):

Gestão

Gestão (P.L.)

1.1.2. *Designation*

Market and Financial Products

Course(s):

Degree in Management

1.2. Sigla da área científica em que se insere

1.2.1. Sigla da área científica

FN

1.2.2. *Scientific area's acronym*

FN

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:	0067:30	(OT) Orientação Tutorial:	0010:00
(P) Práticas:	0000:00	(E) Estágio:	0000:00
(PL) Práticas Laboratoriais:	0000:00	(O) Outras:	0000:00
(S) Seminário:	0000:00		
Horas Contacto:	0077:30		

1.5.2. Contact hours

(T) Theoretical:	0000:00	(TC) Field Work:	0000:00
(TP) Theoretical-practical:	0067:30	(OT) Tutorial Guidance:	0010:00
(P) Practical:	0000:00	(E) Internship:	0000:00
(PL) Laboratory practices:	0000:00	(O) Other:	0000:00
(S) Seminar:	0000:00		
Contact Hours:	0077:30		

1.5.3. % Horas de contacto à distância

Sem horas de contacto à distância

1.5.4. % Remote contact hours

No remote hours

1.6. ECTS

6

2. Docente responsável e respetiva carga letiva na Unidade Curricular

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

HÉLIO MIGUEL GOMES MARQUES

Sem carga letiva

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

HÉLIO MIGUEL GOMES MARQUES

No lecturing load

3. Outros docentes e respetivas cargas letivas na Unidade Curricular

3.1. Outros docentes e respetivas carga letivas

FRANCISCO ERNESTO FREIRE MIRA

TPGD44 (3 horas semanais; 45 horas semestrais)

JOAQUIM PAULO VIEGAS FERREIRA DE CARVALHO

TPGD43ING (45.5 horas semanais; 67.5 horas semestrais), TPGN43ING (4.5 horas semanais; 67.5 horas semestrais)

MARIA MANUELA MARTINS DOS SANTOS DOMINGOS NUNES FERREIRA

TPGN42 (4.5 horas semanais; 67.5 horas semestrais)

RICARDO EMANUEL SARMENTO CORREIA

TPGD41 (4.5 horas semanais; 67.5 horas semestrais), TPGD42 (4.5 horas semanais; 67.5 horas semestrais), TPGN41 (4.5 horas semanais; 67.5 horas semestrais)

SÓNIA MARGARIDA RICARDO BENTES

TPGD44 (1.5 horas semanais; 22.5 horas semestrais)

3.2. *Other academic staff and lecturing load*

FRANCISCO ERNESTO FREIRE MIRA

TPGD44 (3 week hours; 45 semester hours)

JOAQUIM PAULO VIEGAS FERREIRA DE CARVALHO

TPGD43ING (45.5 week hours; 67.5 semester hours), TPGN43ING (4.5 week hours; 67.5 semester hours)

MARIA MANUELA MARTINS DOS SANTOS DOMINGOS NUNES FERREIRA

TPGN42 (4.5 week hours; 67.5 semester hours)

RICARDO EMANUEL SARMENTO CORREIA

TPGD41 (4.5 week hours; 67.5 semester hours), TPGD42 (4.5 week hours; 67.5 semester hours), TPGN41 (4.5 week hours; 67.5 semester hours)

SÓNIA MARGARIDA RICARDO BENTES

TPGD44 (1.5 week hours; 22.5 semester hours)

4. Objetivos de aprendizagem

4.1. Objetivos de aprendizagem e a sua compatibilidade com o método de ensino (conhecimentos, aptidões e competências a desenvolver pelos estudantes)

Proporcionar aos alunos uma visão integrada do Mercado Financeiro e respetiva segmentação. Descrição dos produtos emitidos nos diversos segmentos do Mercado Financeiro na dupla vertente do emitente e do investidor, assim como, a análise de rentabilidade e risco dos mesmos.

4.2. *Learning objectives and their compatibility with the teaching method (knowledge, skills and competencies to be developed by students)*

To provide an integrated view of the financial market and their segmentation. Description of the issued products in the various segments of the financial market in the double strand of the issuer and investor, as well as the analysis of profitability and risk of financial products.

5. Conteúdos programáticos

5.1. Conteúdos

Programa:

1. Introdução aos mercados financeiros
2. Mercado Monetário
3. Mercado de Capitais
4. Teoria da carteira e equilíbrio de mercado
5. Mercado Cambial
6. Fundos de Investimento
7. Derivados

5.2. Syllabus

Syllabus:

1. Introduction to financial markets
2. Monetary market
3. Capital Markets
4. Portfolio Theory and market equilibrium
5. Forex market
6. Investment Funds
7. Derivatives

6. Demonstração da coerência dos conteúdos programáticos

6.1. Demonstração da coerência dos conteúdos programáticos com os objetivos de aprendizagem da unidade curricular

A complementaridade das metodologias propostas tem por objetivo potenciar a abordagem teórica, mas também prática do aluno. As metodologias de ensino e de aprendizagem visam o desenvolvimento integrado dos conhecimentos referidos nos conteúdos programáticos e a concretização dos objetivos de aprendizagem definidos.

O objetivo 1, proporcionar aos alunos uma visão integrada do Mercado Financeiro e respetiva segmentação será atingido ao lecionar os capítulos 1 e 5.

O objetivo 2, descrição dos produtos emitidos nos diversos segmentos do Mercado Financeiro na dupla vertente do emitente e do investidor, será atingido através dos capítulos 2 e 3.

O objetivo 3, análise de rentabilidade e risco dos produtos financeiros, será atingido ao lecionar os capítulos 2, 3 e 6.

O objetivo 4, análise da rentabilidade e risco de uma carteira de ativos financeiros, será atingido ao lecionar o capítulo 4.

O objetivo 5, caracterização dos produtos derivados, será atingido ao lecionar o capítulo 7.

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

The complementarity of the proposed methodologies aims to potentiate the theoretical approach, but also the student's practice. The teaching and learning methodologies aim at the integrated development of the knowledge referred to in the programmatic content and the achievement of the defined learning objectives.

Objective 1, to provide students with an integrated view of the Financial Market and its segmentation, will be achieved by teaching chapters 1 and 5.

Objective 2, describing the products issued in the various segments of the Financial Market from the dual perspective of the issuer and the investor, will be achieved through chapters 2 and 3.

Objective 3, analysing the profitability and risk of financial products, will be achieved by teaching chapters 2, 3 and 6.

Objective 4, analysing the return and risk of a portfolio of financial assets, will be achieved by teaching chapter 4.

Objective 5, characterisation of derivative products, will be achieved by teaching chapter 7.

7. Metodologias de ensino**7.1. Metodologias de ensino e de aprendizagem específicas da unidade curricular articuladas com o modelo pedagógico**

O conteúdo da unidade curricular está organizado de forma integrada, visando transmitir ao aluno um conjunto de conceitos, instrumentos e a estrutura do mercado financeiro. O programa é exposto numa componente teórica e prática, com recurso frequente a exemplos práticos e exercícios, levando a uma melhor compreensão do mercado financeiro. Será disponibilizado, através do Moodle, um caderno de casos práticos.

7.2. *Teaching and learning methodologies specific to the curricular unit articulated with the pedagogical model*

The content of the curricular unit is organized in an integrated manner, aiming to convey to the student a set of concepts, instruments and the structure of the financial market. The program is presented in both theoretical and practical components, with frequent use of practical examples and exercises, leading to a better understanding of the financial market. A notebook of practical cases will be made available through Moodle.

8. Avaliação

8.1 Avaliação

Propõe-se um procedimento de avaliação contínua cuja aprovação na unidade curricular pressupõe classificação ponderada igual ou superior a dez valores nos seguintes moldes:

- Teste escrito intercalar 50%
- Teste escrito avaliação sumativa 50%

Uma nota inferior a 7 valores em qualquer dos momentos de avaliação implica automaticamente a reprovação em avaliação contínua.

Como alternativa de avaliação, para os alunos que não reunirem os requisitos acima exigíveis, haverá lugar a avaliação final através de prova escrita única na qual, para obterem aprovação, os alunos devem, também, ter nota igual ou superior a dez valores.

8.2 Evaluation

It proposes a continuous evaluation procedure whose approval in the curricular unit presupposes a weighted classification equal to or greater than ten values in the following molds:

- Written test interim 50%
- Written test summative evaluation 50%

A grade of less than 7 values in any evaluation moments, automatically implies failure in continuous evaluation.

Alternatively, for students who do not complete the above requirements, there will be a final single written exam in which students must also have a grade, equal to or greater than ten.

9. Demonstração da coerência das metodologias

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

O conteúdo da unidade curricular está organizado de forma integrada, visando transmitir ao aluno um conjunto de conceitos, instrumentos e a estrutura do mercado financeiro, permitindo atingir os objetivos (1) proporcionar aos alunos uma visão integrada do Mercado Financeiro e respetiva segmentação e (2) descrição dos produtos emitidos nos diversos segmentos do Mercado Financeiro na dupla vertente do emitente e do investidor.

O programa é exposto numa componente teórica e prática, com recurso frequente a exemplos práticos e exercícios, levando a uma melhor compreensão do mercado financeiro. Esta metodologia está presente ao longo de todo o programa da unidade curricular, assumindo uma componente prática, com recurso a um caderno de casos práticos, o que permite atingir os objetivos (3) análise de rentabilidade e risco dos produtos financeiros e (4) análise da rentabilidade e risco de uma carteira de ativos financeiros. Para atingir o objetivo (5) caracterização dos produtos derivados, será utilizada uma metodologia teórica e prática.

A avaliação tem presente a abordagem teórica e prática da unidade curricular, pelo que os testes de avaliação contemplam de igual modo uma componente teórica e uma componente prática.

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

The content of the course is organized in an integrated manner, with the aim of providing students with a set of concepts, instruments and the structure of the financial market, allowing them to achieve the objectives of (1) providing students with an integrated view of the Financial Market and its segmentation and (2) describing the products issued in the various segments of the Financial Market from the dual perspective of the issuer and the investor.

The program has a theoretical and practical component, with frequent recourse to practical examples and exercises, leading to a better understanding of the financial market. This methodology is present throughout the syllabus, with a practical component, using a casebook, which enables the objectives (3) analysis of the return and risk of financial products and (4) analysis of the return and risk of a portfolio of financial assets to be achieved. To achieve objective (5) characterization of derivatives, a theoretical and practical methodology will be used.

Assessment considers the theoretical and practical approach of the course, so the assessment tests include both a theoretical and a practical component.

10. Bibliografia de consulta/existência obrigatória

BODIE, Z., Kane, A. & Marcus, A. (2021). *Investments* (12th Edition). McGraw-Hill.

BREALEY, R., MYERS, S., ALLEN, F. (2013). *Princípios de Finanças Corporativas*, (10ª Edição). McGraw Hill

HULL, J. (2017). *Options, Futures and Other Derivatives* (10th Edition). Pearson Education, Inc.

MISHKIN, Frederic (2022). *The Economics of Money, Banking and Financial Markets* (13th Edition). Pearson

MOTA, António Gomes, et. al.; Investimentos Financeiros - Teoria e Prática (3ª Edição), Edições Sílabo

PIRES, C. (2011). *Mercados e Investimentos Financeiros* (3ª Edição). Escolar Editora

SAUNDERS, A., e CORNETT, M. (2019). *Financial Markets and Institutions* (7th Edition). McGraw-Hill

SOARES, I., e PINHO, C. (2018). *Finanças - Mercados e Instrumentos* (3ª Edição). Edições Sílabo

11. Observações**11.1. Observações**

11.2. Observations
