

MÓDULO Modelos financeiros discretos – Apreçamento de ativos e escolha de carteira

- Unidade curricular: Modelos financeiros discretos – Apreçamento de ativos e escolha de carteira
- Departamento de Ciências e Tecnologia
- Nível do curso: Pós-graduação
- Docente responsável: Marta Faias
- Número de horas de aula - 18 Horas Teórico-Práticas + 6 horas em e-learning

Objectivos da unidade curricular:

Pretende-se que os formandos adquiram conhecimentos sobre os principais modelos financeiros de apreçamento de produtos financeiros e escolha de carteira a tempo discreto. Com esta formação, os formandos ficam a conhecer os fundamentos microeconómicos subjacentes a estes modelos, e serão capazes de os aplicar para resolver problemas de valorização de novos instrumentos financeiros e de escolha de uma carteira de ativos diversificada, de modo a minimizar o risco e maximizar a rentabilidade.

Conteúdo da unidade curricular:

1. Teoria do consumidor
2. Escolha em contexto de incerteza
3. Teoria de jogos
4. Modelo de Equilíbrio geral com mercados financeiros
5. CAPM - Capital Asset Pricing Model
6. Modelo de fatores
7. Modelo de arbitragem --- APT
8. Aplicações

Bibliografia recomendada (máx. 5 títulos):

1. Bodie, Z., Kane, A. and Marcus, A., Essentials of Investments, McGraw-Hill, 2008.
2. Magill, M. and Quinzii, M., Incomplete Markets: vol. I: finite horizon economies and vol. II: infinite horizon economies, Cheltenham, Northampton: An Elgar Reference Collection, cop. 2008.

3. Pires, C.P., Mercados e Investimentos Financeiros, Escolar Editora, 3ª edição, 2011.
4. Varian, H., Microeconomic Analysis, Viva-Norton Student Edition, 2009.

Métodos de ensino:

Os assuntos a estudar são introduzidos através de uma exposição oral cujo principal objetivo é motivar no aluno o interesse pelo estudo desse assunto ao mesmo tempo que se chama a atenção do ouvinte para pontos dignos de especial menção. Numa segunda fase os alunos são incitados a resolverem sozinhos os exercícios propostos sendo debatidos nas aulas aqueles que suscitam mais dúvidas. Em e-learning, serão discutidos os trabalhos práticos de aplicação dos modelos lecionados, assim como dadas indicações aos alunos que ajudarão na resolução destes. Serão também esclarecidas dúvidas. Espera-se uma interação com o aluno que permita ao docente perceber se o aluno está a resolver corretamente o trabalho e fazer, se necessário, sugestões de correção.

Língua de ensino: Português e se necessário Inglês.

Docentes: Marta Faias