

Curso: Administração | Código: ENEX60861 | Vigência: 2021

Carga Horária: 40 horas

Nome do Componente Curricular:

Aulas Semanais:

Investimentos

2 Teóricas/0 Práticas

Etapa: 6

Ementa:

Conhecer o funcionamento do mercado de ações e de renda fixa. Saber analisar o risco e retorno de uma ação isolada e de um conjunto de ações (carteira). Entender como o risco afeta o retorno esperado de um ativo e qual é o seu impacto no preço de uma ação ou um ativo qualquer. Análise de títulos privados e públicos. Fundos de Investimento. Noções de Derivativos.

Objetivo:

Analisar de que forma o equilíbrio de um maior retorno esperado pode compensar alternativas de investimento arriscadas. Os fundamentos de diferentes modelos que precificam o risco são analisados, e a aplicabilidade e consequências destes modelos serão considerados. Os princípios são aplicados aos mercados de ações, de rendimento fixo e de derivativos.

Metodologia/Diretivas:

O desenvolvimento das aulas se baseará em exposições e críticas sobre os conceitos, em discussões sobre leituras de textos atuais da imprensa especializada incluindo debates, seminários e em trabalhos práticos: Estudos de Casos, Trabalhos individuais e em grupo, Testes; Questões, Problemas e Exercícios de Verificação de Aprendizagem.

Avaliação:

A avaliação da aprendizagem será sistemática e cumulativa, com prevalência dos aspectos qualitativos sobre os quantitativos e dos resultados ao longo do período sobre o desempenho em situações pontuais, provocando a reflexão crítica do aluno a respeito dos temas abordados. Será feita através da avaliação dos trabalhos de pesquisa (tarefas), individuais e/ou em grupo, realizados em classe ou extraclasse baseados nos estudos de caso ou temas apresentados em aula e provas individuais.

Conteúdo Programático:

1. Estrutura do Sistema Financeiro Nacional;
2. Mercado Monetário e Títulos de Renda Fixa (Públicos e Privados);
3. Mercado de Capitais (Primário e Secundário);
4. Relação Risco e Retorno;
5. Teoria de Carteiras;

6. Modelos de precificação de ativos;
7. Fundos de Investimento e análise de desempenho;
8. Mercado de Derivativos.

Bibliografia Básica:

ASSAF NETO, Alexandre. **Mercado Financeiro**. 13ª ed. São Paulo: Atlas, 2015.

BODIE, Zvi; KANE, Alex; MARCUS, Alan J. **Fundamentos de Investimentos**. 9ª ed. Porto Alegre: AMGH, 2014.

ELTON, Edwin J.; GRUBER, Martin J.; BROWN, Stephen J.; GOETZMANN, William N. **Moderna Teoria de Carteiras e Análise de Investimentos**. Rio de Janeiro, 2012.

Bibliografia Complementar:

BODIE, Zvi; KANE, Alex; MARCUS, Alan J. **Investimentos**. 10ª ed. Porto Alegre: AMGH, 2014.

BREALEY, Richard A.; MYERS, Stewart C.; ALLEN, Franklin. **Princípios de Finanças Corporativas**. 10ª ed. Porto Alegre: AMGH, 2013.

EHRHARDT, Michael C.; BRIGHAM, Eugene F. **Administração Financeira: Teoria e Prática**. Tradução da 14ª edição norte-americana. São Paulo: Cengage Learning, 2016.

REILLY, Frank, K.; NORTON, Edgar A. **Investimentos**. Tradução da 7ª edição norte-americana. São Paulo: Cengage Learning, 2008.

ROSS, Stephen A.; WESTERFIELD, Randolph W.; JORDAN, Bradford D.; LAMB, Roberto.

Fundamentos de Administração Financeira. 9ª ed. Porto Alegre: AMGH, 2013.