



Curso de especialização em **Mercados Financeiros e de Capitais**

Estrutura Curricular – componente curricular/carga horária.

Módulo: Fundamentos	
Ambiente Econômico	32 h/a
Contabilidade Empresarial	32 h/a
Métodos Quantitativos Aplicados ao Mercado Financeiro	64 h/a
Carga horária total do módulo	128 horas-aulas
Módulo: Análise	
Estrutura e Operação do Mercado Financeiro	64 h/a
Fundamentos de Investimento	64 h/a
Carga horária total do módulo	128 horas-aulas
Módulo : Gestão	
Avaliação de Investimentos em Títulos de Renda Fixa e Gestão de Fundos de Investimento	64 h/a
Derivativos: Termos, Futuros, Swaps e Opções	32 h/a
Gestão de Riscos	32 h/a
Carga horária total do módulo	128 horas-aulas
Módulo: Metodologia do Trabalho Científico	48 horas-aulas à distância
Total da carga horária do curso	432 horas-aulas



IDENTIFICAÇÃO DO COMPONENTE CURRICULAR - 1

1. Nome do Componente Curricular: Ambiente Econômico
2. Carga Horária: 32 h/a
3. Ementa: Análise do ambiente econômico onde estão inseridas as instituições financeiras e as empresas, que sofrem o impacto das políticas brasileiras de caráter fiscal e monetário, assim como os impactos da globalização e das políticas dos blocos geopolíticos.
4. Objetivo: Capacitar o participante a avaliar e compreender o ambiente econômico interno e externo, a fim de contribuir para a projeção de cenários e estratégias de negócios.
5. Conteúdo Programático:
 - O Balanço de Pagamento;
 - Endividamento interno, externo e reservas internacionais;
 - Condições para obtenção do equilíbrio nas contas internas e externas;
 - Regimes cambiais e fluxos de capitais externos;
 - Fundo Monetário Internacional;
 - A política monetária no Brasil
 - O papel do Banco Central
 - Captação de recursos externos no mercado internacional de fundos: instituições e instrumentos;
 - Projeção de cenários econômicos



6. Bibliografia:

▪ Básica:

DORNBUSCH, Rudiger. **Macroeconomia**. 10. Porto Alegre: AMGH, 2011.

FROYEN, Richard T. **Macroeconomia: teorias e aplicações**. 2. ed. São Paulo: Saraiva, 2013.

MANKIW, N. Gregory; HASTINGS, Allan Vidigal (Trad.). **Introdução à economia**. São Paulo: Cengage Learning, 2015.

▪ Complementar:

BLANCHARD, Olivier; MARTINS, Claudia (Trad.). **Macroeconomia**. 5. ed. São Paulo: Pearson Prentice Hall, 2013.

IPEA (Colab.). **Clássicos de literatura econômica**: textos selecionados de macroeconomia. 3. ed. Rio de Janeiro: IPEA, 2010.

PINHO, Diva Benevides; VASCONCELLOS, Marco Antonio Sandoval de; GREMAUD, Amaury Patrick (Org.). **Manual de economia**. 6. ed. São Paulo: Saraiva, 2014.

SIMONSEN, Mario Henrique. **Macroeconomia**. 4. São Paulo Atlas 2009. (*)

(*) clássico

- Bases de dados disponíveis no sistema da biblioteca como Proquest, EBSCO, JSTOR, Portal CAPES.



IDENTIFICAÇÃO DO COMPONENTE CURRICULAR - 2

1. Nome do componente curricular: Contabilidade Empresarial
2. Carga Horária: 32 h/a
3. Ementa: Princípios fundamentais da contabilidade e da análise das demonstrações financeiras para tomada de decisões, incluindo as principais metodologias para sua elaboração.
4. Objetivo: Habilitar os participantes a utilizar os conceitos essenciais da contabilidade, como uma ferramenta para o controle e a gestão dos resultados econômico-financeiras das empresas.
5. Conteúdo Programático:
 - Breve Histórico da Contabilidade e seu desenvolvimento como ferramenta de auxílio ao administrador e gestor das organizações;
 - Principais usuários das informações;
 - Principais aspectos dos relatórios contábeis; princípios fundamentais da Contabilidade;
 - Demonstrações Financeiras;
 - Balanço Patrimonial; Demonstração do Resultado do Exercício;
 - Demonstração da Mutação do Patrimônio Líquido;
 - Demonstração do Fluxo de Caixa;
 - Notas Explicativas e parecer da Auditoria Independente;



- Análise das Demonstrações Financeiras – Índices Financeiros; Liquidez; Endividamento; Atividade; Lucratividade/ Rentabilidade; EBITDA; Retorno sobre o Investimento; Retorno sobre o Patrimônio Líquido.

6. Bibliografia:

- Básica

CARDOSO, Ricardo Lopes. **Contabilidade geral**: introdução à contabilidade societária. 4. São Paulo: Atlas 2013, 1 *recurso online*.

IUDÍCIBUS, Sérgio de; MARION, José Carlos. **Curso de contabilidade para não contadores**: para as áreas de administração, economia, direito e engenharia. 7. ed. São Paulo: Atlas, 2011.

MARION, José Carlos. **Contabilidade empresarial**: texto. 17. São Paulo Atlas 2015.

- Complementar:

BERTI, Anélio. **Contabilidade gerencial**: uma ferramenta de apoio à gestão. Curitiba: Juruá, 2011.

CREPALDI, Silvio Aparecido. **Contabilidade gerencial**: teoria e prática. 8. Rio de Janeiro Atlas 2017.

HORNGREN, Charles T.; SUNDEM, Gary L.; STRATTON, William O. **Contabilidade gerencial**. 12. ed. São Paulo: Prentice-Hall, 2010.

QUINTANA, Alexandre Costa. **Contabilidade básica** : com exercícios práticos de acordo com as normas brasileiras de contabilidade do cfc. São Paulo Atlas 2014.

NECYK, George Anthony. **Contabilidade gerencial nas empresas**: o desenvolvimento e uma perspectiva de ciclo de vida . São Paulo: Quartier Latin, 2010.

- Bases de dados disponíveis no sistema da biblioteca como Proquest, EBSCO, JSTOR, Portal CAPES.



IDENTIFICAÇÃO DO COMPONENTE CURRICULAR - 3

1. Nome do componente curricular: Métodos Quantitativos Aplicados ao Mercado Financeiro
2. Carga Horária: 64 h/a
3. Ementa: Cálculo financeiro de juros, fluxos de caixa, análise do fluxo de caixa descontado, e de estatística descritiva, probabilidade, estatística inferencial e regressão. A abordagem é a aplicação prática da teoria, com exemplos de aplicação, e implementações em planilhas eletrônicas como o MSExcel, e calculadoras eletrônicas, além da utilização do software SPSS e de fundamentos da estatística.
4. Objetivo: capacitar os participantes a analisar os principais problemas que surgem em projetos econômico-financeiros e de operações financeiras, sejam eles privados ou públicos.
5. Conteúdo Programático:
 - Conceitos Básicos de Matemática Financeira-Juros, Capital, Montante e Taxa de Juros;
 - Sistema de Capitalização Simples e Composta;
 - Séries Uniformes de Pagamentos;
 - Métodos de Avaliação de Investimentos: VPL; TIR; TIR Modificada; *Payback*;
 - Estrutura das Taxas de Juros – Fórmula da Separação de Fisher;
 - Análise de Risco;
 - Teoria da Decisão;
 - Análise de Sensibilidade e Simulação de Fluxos de Caixa;
 - Propriedades da Média e da Variância. Aplicações na determinação da Fronteira Eficiente de Carteiras (*"Portfolio Selection"*/Markowitz);
 - Principais Distribuições Discretas de Probabilidades. Distribuições Equiprovável, Binomial, *Poisson*;



UNIVERSIDADE PRESBITERIANA MACKENZIE
PRÓ-REITORIA DE EXTENSÃO E EDUCAÇÃO CONTINUADA
Coordenadoria de Cursos de Educação Continuada



- Principais Distribuições Contínuas. Distribuições Uniforme, Exponencial, Normal;
- Distribuições Amostrais da Média e da Variância;
- Testes de Hipóteses com uma Amostra e com duas Amostras;
- Análise de Regressão, Regressão Linear Simples;
- CAPM - *Capital Asset Pricing Model*.

6. Bibliografia:

- Básica:

BUSSAB, Wilton de Oliveira; MORETTIN, Pedro Alberto. **Estatística básica**. 8. ed. São Paulo: Saraiva, 2015.

VIEIRA SOBRINHO, José Dutra. **Matemática financeira**: juros, capitalização, desconto e séries de pagamentos. Operações realizadas no Sistema Financeiro Brasileiro: letras de câmbio, CDB, cadernetas de poupança, debêntures, capital de giro, Finame, Resolução n. 63, leasing e aquisição de casa própria. Utilização de minicalculadoras financeiras. 7. ed. 13ª reimpressão São Paulo: Atlas, 2011.

SWEENEY, Dennis J.; WILLIAMS, Thomas A.; ANDERSON, David R. **Estatística aplicada à administração e economia**. 3. ed. São Paulo: Cengage Learning, 2014.

- Complementar:

HILL, R. Carter; GRIFFITHS, William E.; JUDGE, George G. **Econometria**. 3. ed. São Paulo: Saraiva, 2010.

MATHIAS, Washington Franco; GOMES, José Maria. **Matemática financeira**: com + de 600 exercícios resolvidos e propostos. 6. ed. São Paulo: Atlas, 2014.

ROSS, Stephen A. **Administração financeira**. 8. Porto Alegre: AMGH, 2015.



- Bases de dados disponíveis no sistema da biblioteca como Proquest, EBSCO, JSTOR, Portal CAPES.

IDENTIFICAÇÃO DO COMPONENTE CURRICULAR - 4

1. Nome do componente curricular: Estrutura e Operação do Mercado Financeiro
2. Carga Horária: 64 h/a
3. Ementa: o componente curricular trata da estrutura e do funcionamento do mercado financeiro nacional, do inter-relacionamento entre os mercados de capitais, crédito, câmbio, juros e de títulos, através de abordagem conceitual e prática.
4. Objetivo: Habilitar o participante e se posicionar no mercado financeiro pelo conhecimento dos seus vários componentes, assim como pela compreensão dos mecanismos das principais operações desta área.
5. Conteúdo Programático:
 - O Sistema Financeiro Nacional – origem, evolução, estrutura, instituições e principais produtos financeiros;
 - Introdução à Teoria Financeira. - Origens e Evolução do Processo de Intermediação Financeira. O Modelo de Gurley-Shaw. Benefícios Micro e Macroeconômicos. Desenvolvimento Econômico e Desenvolvimento Financeiro.
 - O Funcionamento do Sistema Bancário no Brasil. Bancos de Rede e de Atacado. Corporate, Private e Personal Bank.
 - Conceitos de *Funding*, *Floating*, *Spread*, Alavancagem Financeira e o Acordo de Basiléia.
 - Segmentação do Mercado Financeiro - Funções e Características dos Mercados Monetário, Crédito, Cambial, de Capitais e de Derivativos.



UNIVERSIDADE PRESBITERIANA MACKENZIE
PRÓ-REITORIA DE EXTENSÃO E EDUCAÇÃO CONTINUADA
Coordenadoria de Cursos de Educação Continuada



- Operacionalização da Política Monetária. Estratégias Defensiva e Dinâmica. Zeragem do Mercado. Autonomia e Passividade da Política Monetária.
- A Inflação Brasileira; Conceitos e Principais Tipos de Inflação, Indicadores de Inflação.
- O Sistema Monetário Internacional. A Evolução do Sistema Monetário Internacional - Do Padrão-Ouro ao Sistema de Bretton Woods. Inconvertibilidade do Dólar e Falência do Sistema. 5.1. O Fundo Monetário Internacional - Principais Operações de Crédito. Direitos Especiais de Saque. Outras Instituições Internacionais de Crédito (BIRD, BID, etc.).
- O Mercado de Euromoeda. Captação de Recursos no Mercado Internacional de Capitais.
- A Globalização Financeira. Fluxos de Entrada e Saída de Capitais e os Impactos nas Economias dos Países Emergentes

6. Bibliografia:

- Básica:

ASSAF NETO, Alexandre. **Mercado financeiro**. 12. ed. São Paulo: Atlas, 2014.

FORTUNA, Eduardo. **Mercado financeiro: produtos e serviços**. 18. ed., rev., atual. Rio de Janeiro: Qualitymark, 2011.

TOLEDO FILHO, Jorge Ribeiro de. **Mercado de capitais brasileiro** : uma introdução. São Paulo: Cengage Learning 2012.

- Complementar:

FABOZZI, Frank J.; MODIGLIANI, Franco; JONES, Frank Joseph. **Foundations of financial markets and institutions**. 4th ed. Upper saddle river, n.j.: PrenticeHall, 2010.

KERR, Roberto Borges. **Mercado financeiro e de capitais**. São Paulo: Pearson, 2011. *(recurso online)*.

ROGANTE, Sérgio. **Mercado financeiro brasileiro**: mudanças esperadas para adaptação a um ambiente de taxas de juros declinantes. São Paulo: Atlas, 2009.



PINHEIRO, Juliano Lima. Mercado de **capitais**. 8. Rio de Janeiro Atlas 2016

- Bases de dados disponíveis no sistema da biblioteca como Proquest, EBSCO, JSTOR, Portal CAPES.

IDENTIFICAÇÃO DO COMPONENTE CURRICULAR – 5

1. Nome da Disciplina: Fundamentos de Investimento
2. Carga Horária: 64 h/a
3. Ementa: Apresentação e discussão da teoria de carteiras e o CAPM; os fundamentos da análise do risco e retorno e da administração do risco.
4. Objetivo: Habilitar o participante a tomar decisões com base nos conhecimentos para análise de investimentos e administração de carteiras de acordo com a moderna teoria financeira.
5. Conteúdo Programático:
 - Introdução à gestão de investimentos;
 - Análise fundamentalista de ações;
 - Medidas de risco e retorno;
 - Teoria de carteiras;
 - Carteira de Mínima Variância;
 - Fronteira Eficiente;
 - O ativo livre de risco e a carteira tangencial;
 - Reta característica de um ativo em função do ativo de mercado;



UNIVERSIDADE PRESBITERIANA MACKENZIE
PRÓ-REITORIA DE EXTENSÃO E EDUCAÇÃO CONTINUADA
Coordenadoria de Cursos de Educação Continuada



- Decomposição do risco total;
- *Hedge* da carteira;
- Modelos de precificação de ativos: CAPM, Fatores e APT;
- Métodos de avaliação de desempenho de carteiras: Índices de Jensen, Sharpe, Treynor e Modigliani;
- Análise Fundamentalista;
- Ativo Livre de Risco;
- Carteira "T" - Teorema de um só fundo
- Reta Característica
- Cálculo do risco total, sistemático e não-sistemático.
- Mercado Futuro-Hedge de Beta

6. Bibliografia

- Básica:

ASSAF NETO, Alexandre. **Mercado financeiro**. 10. ed. São Paulo: Atlas, 2011.

BODIE, Zvi; KANE, Alex; MARCUS, Alan J.; HONORATO, Beth
(Trad.). **Investimentos**. 10. ed. São Paulo: AMGH, 2016.

ROSS, Stephen A. **Administração financeira**. 8. Porto Alegre AMGH 2015

- Complementar:

CAMLOFFSKI, Rodrigo. **Análise de investimentos e viabilidade financeira das empresas**. São Paulo Atlas 2014.



DAMODARAM, Aswath. *Corporate finance: theory and practice*. 2. ed. New York: John Wiley, 2001. (*)

DE BONDT, Werner Franciscus Marcel (Ed.). *Financial accounting and investment management*. Cheltenham, UK: Edward Elgar, 2009.

GITMAN, Lawrence J.; SANVICENTE, Antonio Zoratto (Trad.). **Princípios de administração financeira**. 12. ed. São Paulo: Pearson/Addison Wesley, 2013.

GRUBER, Martin J. *Modern portfolio theory and investment analysis*. 6th. ed. New York: John Wiley, 2003. (*)

- Bases de dados disponíveis no sistema da biblioteca como Proquest, EBSCO, JSTOR, Portal CAPES.

(*) Clássico

IDENTIFICAÇÃO DO COMPONENTE CURRICULAR – 6

1. Nome do componente curricular: Avaliação de Investimentos em Títulos de Renda Fixa e Gestão de Fundos de Investimento
2. Carga Horária: 64 h/a
3. Ementa: Apresentação e análise dos instrumentos de investimento, dos títulos de renda fixa, do retorno e risco de renda fixa, hedge e swaps de renda fixa e da gestão dos fundos de investimento.
4. Objetivo: Habilitar o participante a avaliar os principais instrumentos de investimentos em Renda Fixa e modelos de determinação do preço dos títulos, assim como a análise dos retornos e riscos envolvidos com tais investimentos. Capacitar ainda o aluno a avaliar posições de *hedge* de carteiras de renda fixa e gestão de fundos de investimentos.



5. Conteúdo Programático:

- Precificação de Bônus, Cupom Zero; Opção de Resgate Antecipado
- Medindo Retorno e Volatilidade: Medidas de Retorno; Convexidade; Risco e Retorno; *Duration* e Volatilidade ;
- Taxas de Juro Taxa spot e Taxa base; Estrutura de Taxas e Curvas de Retorno;
- *Hedge e Swaps*;
- Mercado brasileiro de títulos de Renda Fixa; sites Anbid, CVM, CETIP e BCB (volumes e composição) ;
- Títulos Privados e Títulos Públicos;
- *Value at Risk* ;
- Gestão de Fundos de Investimento;

6. Bibliografia:

- Básica:

ASSAF NETO, Alexandre. Mercado Financeiro. São Paulo Atlas, 2011.

FABOZZI, Frank J. **Mercados, Análise e Estratégias de Bônus** - títulos de renda fixa. Rio de Janeiro: Qualitymark, 2000. (*)

JORION, Philippe. **Value at Risk**: a nova fonte de referência para a gestão do risco financeiro. São Paulo, BM&F, 2003. (*)

- Complementar:

DUARTE JÚNIOR, Antonio Marcos. **Gestão de Riscos para Fundos de Investimento**. São Paulo: Pearson, 2005 (livros eletrônicos). (*)

EICHENGREEN, Barry; MATHIESON, Donald. **Hedge funds**: *what do we really know ?*. Washington, dc: International Monetary Fund, 1999. (*)



FERREIRA, Roberto G. **Tesouro direto e outros investimentos financeiros**: LTN, LFT, NTN, CDB, RDB, LCI e LI: planos financeiros e atuariais de aposentadoria. São Paulo: Atlas 2015; 1 recurso *online*.

GITMAN, Lawrence J.; SANVICENTE, Antonio Zoratto (Trad.). **Princípios de administração financeira**. 12. ed. São Paulo: Pearson/Addison Wesley, 2014.

- Bases de dados disponíveis no sistema da biblioteca como Proquest, EBSCO, JSTOR, Portal CAPES.

(*) Clássico

IDENTIFICAÇÃO DO COMPONENTE CURRICULAR – 7

1. Nome da Disciplina: Derivativos: Termos, Futuros, *Swaps* e Opções
2. Carga Horária: 32 h/a
3. Ementa: Apresentação e discussão das características dos mercados de ativos derivados, termo, futuros, opções e *swaps*, assim como dos critérios de avaliação e precificação dos derivativos.
4. Objetivo: capacitar o participante para lidar com os elementos dos mercados de derivativos; aperfeiçoando a compreensão e análise sobre aspectos relacionados com risco, proteção e retorno associados a estes componentes.
5. Conteúdo Programático:
 - Conceito de Derivativos;
 - O Mercado a Termo e de Futuros;
 - Mercado a termo de NDF (*Non Deliverable Forward*) ;
 - O Contrato de Futuros; Formação de Preços de Contratos de Futuros. Análise de tendências no mercado;



UNIVERSIDADE PRESBITERIANA MACKENZIE
PRÓ-REITORIA DE EXTENSÃO E EDUCAÇÃO CONTINUADA
Coordenadoria de Cursos de Educação Continuada



- Taxa de Juros; câmbio; *swaps*;
- Mecanismos de Garantia; e Câmaras de Compensação;
- O Mercado de Opções;
- Classificação das Opções; Opção de Compra; Opção de Venda; Prêmio;
- Análise de Risco e Retorno no Mercado de Opções; Garantia;
- Estratégias; Posições Mistas e Travas no Mercado de opções;
- Formação de Preços nas Opções. Influências: Taxa de juros. Volatilidade. Preço de Objeto e Preço de Exercício da Opção;
- Opções Exóticas; Opções com Índices de Ações; Opções com Moedas. Opções com Contratos Futuros;
- O Modelo de Black & Scholes;
- O Mercado de *Swaps*.

6. Bibliografia:

- Básica:

HULL, John; BOLSA DE MERCADORIAS & FUTUROS (BRASIL). Fundamentos dos mercados futuros e de opções. São Paulo: BM&F, 2010.

MACHADO, Sérgio Jurandy; ROSSI JÚNIOR, José Luiz; RIBEIRO, Philippe Lemes. **Swap, futuro e opções**: impacto do uso de instrumentos derivativos sobre o valor das firmas brasileiras. RAM: Revista de Administração Mackenzie, São Paulo , v.14, n.1, p. [126] - 142, jan./fev. 2013.

LION, Octávio Manuel Bessada; BARBEDO, Cláudio Henrique; ARAÚJO, Gustavo Silva. **Mercado de derivativos no Brasil**: conceitos, operações e estratégias. 3. ed. rev. Rio de Janeiro: Record, 2009.



- Complementar:

BREALEY, Richard A.; MYERS, Stewart C.; ALLEN, Franklin. **Princípios de finanças corporativas**. 8. ed. São Paulo: McGraw-Hill, 2008.

COPELAND, Thomas E.,; WESTON, F. Fred. **Financial theory and corporate policy**. 4th. ed. Massachusetts: Addison-Wesley, 2003. (*)

LION, Octávio Manuel Bessada; BARBEDO, Cláudio Henrique; ARAÚJO, Gustavo Silva. **Mercado de derivativos no Brasil: conceitos, operações e estratégias**. 3. ed. rev. Rio de Janeiro: Record, 2009.

WILMOTT, Paul. Paul Wilmott. **On quantitative finance**. New York: John Wiley, 2000. (*)

- Bases de dados disponíveis no sistema da biblioteca como Proquest, EBSCO, JSTOR, Portal CAPES.

(*) Clássico

IDENTIFICAÇÃO DO COMPONENTE CURRICULAR – 8

1. Nome do componente curricular: Gestão de Riscos
2. Carga Horária: 32 h/a
3. Ementa: Apresentação dos fundamentos teóricos e das ferramentas para avaliação e mensuração de riscos em investimentos financeiros e tomada de decisões em projetos de investimentos.
4. Objetivo: capacitar o participante a mensurar o risco financeiro dos investimentos, contribuindo para o incremento da assertividade nas tomadas de decisões que envolvem risco e retorno.



5. Conteúdo Programático:

- Conceituação de risco; tipos de riscos;
- Ferramentas de gestão de riscos;
- Definição operacional de risco; Distribuições Normal e Log-Normal
• Média, Variância e Desvio-Padrão; Dispersão; VAR Paramétrico e Não-Paramétrico;
- O Risco na Renda Variável; Ativos de Renda Variável;
- Títulos-Bônus e Índices; Carteira de ativos-CAPM; Diversificação de *Portfolio*; Beta de Risco;
- O Risco na Renda Fixa; Estrutura a termo da taxa de juros; Instrumentos de Renda Fixa; Termos/Futuros na gestão de risco de Renda Fixa; *Swaps* *Duration* e Convexidade;
- O Risco presente nos Swaps; o risco presente nas Opções; o modelo Binomial; o modelo de Black & Scholes; o uso das gregas e as estratégias de gestão de risco de derivativos;
- Mapeamento das Posições; origem do risco financeiro; medidas de exposição linear - Primeira Ordem e Segunda Ordem; RAROC; cálculo do VAR Paramétrico e Não-Paramétrico;
- Avaliação do Modelo de Risco; Confrontos com a realidade; *Backtesting* do modelo; Testes de *Stress* do modelo; Auditorias e Supervisões Independentes;
- Administração de Risco ; Limitações do VAR; o risco de exceder-se o VAR; o risco de mudança de Posições; o risco de Evento e Estabilidade; o risco de Transição; o risco de dados Inadequados; o risco de Modelo;



UNIVERSIDADE PRESBITERIANA MACKENZIE
PRÓ-REITORIA DE EXTENSÃO E EDUCAÇÃO CONTINUADA
Coordenadoria de Cursos de Educação Continuada



- Risco de Crédito; Agências de Rating; Enfoque Bancário; Administração de Risco de Crédito; *Credit Scoring*; *Behaviorial Scoring*; Controle de Perdas Financeiras; Diversificação.

6. Bibliografia:

- Básica:

JORION, Philippe. . **Value at Risk**: a nova fonte de referência para a gestão do risco financeiro. São Paulo: BM&F, 2003. (*)

KIMURA, Herbert. **Value-at-risk**: como entender e calcular o risco pelo VAR. São Paulo: Inside Books, 2009.

SECURATO, Jose Roberto. **Decisões financeiras em condições de risco**. 2. ed. São Paulo: Saint Paul, 2007. (*)

- Complementar:

ARDITTI, Fred D. **Derivatives**. *a comprehensive resource for options, futures, interest rate swaps, and mortgage securities*. Boston: Harvard Business School Press, 1996. (*)

GARTNER, Ivan Ricardo; MOREIRA, Tito Belchior Silva; GALVES, Herley Martins. **Análise do risco setorial como instrumento de controle gerencial em instituições financeiras**. RAM: revista de administração Mackenzie, São Paulo, v.10, n.5, set./out. 2009.

DAMODARAN, Aswath. **Gestão estratégica do risco**: uma referência para a tomada de riscos empresariais. Porto Alegre: Bookman, 2009.

SHARPE, William F.; ALEXANDER, Gordon J.; BAILEY, Jeffery V. **Investments**. 6th ed. New Jersey: Prentice-Hall, 1999. (*)



PASCHOARELLI, Rafael. **VAR value at risk**: cálculo do VAR de uma carteira de renda fixa. São Paulo: Saint Paul, 2007. (*)

- Bases de dados disponíveis no sistema da biblioteca como Proquest, EBSCO, JSTOR, Portal CAPES.

(*) Clássico

IDENTIFICAÇÃO DO COMPONENTE CURRICULAR - 9

1. Nome do componente curricular: **Metodologia do Trabalho Científico – Ensino à Distância (MTC- EAD)**
2. Carga Horária: 48 horas
3. Ementa: A disciplina promove o desenvolvimento do trabalho de Monografia, com base no método prático e aplicado, o qual direciona o aluno para a resolução de um desafio ou problema real vivenciado por uma determinada organização, utilizando os conceitos e práticas abordados ao longo do curso.
4. Objetivo: Capacitar o participante para investigar, analisar e compreender as causas e as implicações dos problemas organizacionais; e com base no diagnóstico e na pesquisa bibliográfica, propor soluções e ações detalhadas, visando à resolução dos mesmos.
5. Conteúdo Programático:
 - Definição do problema/desafio organizacional a ser resolvido;
 - Descrição das características gerais da empresa: histórico no mercado de atuação, ramo de atividade, controle societário, produtos e serviços, perfis de clientes e fornecedores, regiões de atuação, quantidade de funcionários e porte econômico;
 - Diagnóstico das origens e implicações do desafio a ser resolvido;
 - Pesquisa bibliográfica sobre os temas relacionados com o desafio organizacional;
 - Proposição de soluções e ações detalhadas para a resolução do desafio.



6. Bibliografia:

• **Básica:**

KERLINGER, F. N.; ROTUNDO, H. M.. **Metodologia da pesquisa em ciências sociais**: um tratamento conceitual. São Paulo: EPU, 2007. (*)

MEDEIROS, J. B. **Redação científica**: a prática de fichamentos, resumos, resenhas. 11. São Paulo: Atlas, 2013.

VERGARA, S. C. **Projetos e relatórios de pesquisa em administração**. 16. São Paulo: Atlas, 2016, 1 recurso online ISBN 9788597007480.

• **Complementar:**

BARDIN, L. **Análise de conteúdo**. Lisboa: Edições 70, 2010. (*)

ISKANDAR, J. I. **Normas da ABNT comentadas para trabalhos científicos**. 5. ed., rev., e atual. Curitiba: Juruá, 2015.

LAKATOS, E. M; MARCONI, M. A. **Técnicas de pesquisa**: planejamento e execução de pesquisas, amostragens e técnicas de pesquisa, elaboração, análise e interpretação de dados. 7. ed. São Paulo: Atlas, 2011.

MARCONDES, R. C.; MIGUEL, L. A. P.; FRANKLIN, M. A.; PEREZ, G. **Guia para elaboração de trabalhos aplicados em administração e contabilidade**. São Paulo: Universidade Presbiteriana Mackenzie, 2017, 4ª edição.

- Bases de dados disponíveis no sistema da biblioteca como Proquest, EBSCO, JSTOR, Portal CAPES.