

INVESTIMENTOS FINANCEIROS

Ementa

Funcionamento do mercado de ações: negociação de ações e cálculo de índices. Análise de risco e retorno de ativos individuais. Teoria de carteiras: risco, retorno e diversificação. Determinação de preços de equilíbrio de mercado de ativos financeiros. Equilíbrio no mercado de capitais: capital asset pricing model (CAPM). Processo de arbitragem e funcionamento de mercados de derivativos. Análise de demonstrativos financeiros. Técnicas de planejamento financeiro de curto prazo. Dimensionamento de capital de giro. Estudo da estrutura de capital, políticas de dividendos e o valor da empresa.

Temas

1. Renda fixa
2. Renda variável
3. Derivativos
4. Teoria de carteiras e precificação de ativos
5. Finanças e valuation

Referências bibliográficas

- ASSAF NETO, A. Finanças corporativas e valor. 8 ed. São Paulo: Grupo GEN, 2020.
- ASSAF NETO, A. Mercado Financeiro. 15 ed. São Paulo: Atlas, 2021.
- BODIE, Z.; KANE, A.; MARCUS, A. J. Fundamentos de investimentos. 9 ed. Porto Alegre: AMGH, 2014.
- BOMFIM, A. N. Derivativos de créditos e outros instrumentos. Rio de Janeiro: Elsevier, 2007.
- BREALEY, R.; MYERS, S.; ALLEN, F. Princípios de Finanças Corporativas. 12 ed. Porto Alegre: AMGH, 2018.
- FORTUNA, E. Mercado financeiro: produtos e serviços. 22 ed. Rio de Janeiro: Qualitymark, 2020.
- GIAMBIAGI, F. Derivativos e risco de mercado. São Paulo: Grupo GEN, 2017.
- GONÇALVES, R.; BAUMANN, R. Economia Internacional: Teoria e Experiência Brasileira. 2 ed. São Paulo: Grupo GEN, 2014.
- PINHEIRO, J. L. Mercado de Capitais. 8 ed. São Paulo: Atlas, 2016.
- ROSS, S. A. et al. Administração financeira. 10 ed. Porto Alegre: AMGH, 2015.