



UNIVERSIDADE FEDERAL DE UBERLÂNDIA
FACULDADE DE CIÊNCIAS INTEGRADAS DO PONTAL
CURSO DE CIÊNCIAS CONTÁBEIS

FICHA DE DISCIPLINA

DISCIPLINA: Mercado de Capitais

CÓDIGO: GAM024

UNIDADE ACADÊMICA: FACIP

PERÍODO/SÉRIE:

CH TOTAL
TEÓRICA:

CH TOTAL
PRÁTICA:

CH TOTAL:

OBRIGATORIA: ()

OPTATIVA: (X)

60

-

60

OBS:

PRÉ-REQUISITOS:

CÓ-REQUISITOS:

OBJETIVOS

Oferecer aos alunos conhecimentos sobre o mercado de capitais, sua estrutura e elementos necessários à plena utilização dos conceitos da teoria de finanças, no que tange à avaliação e diversificação de investimentos e ao gerenciamento de riscos.

EMENTA

1. Introdução: O Sistema Financeiro Nacional
2. Financiamento de empresas e o mercado acionário
3. O investidor e o mercado de ações
4. Técnicas de análise de risco, retorno e liquidez
5. Desempenho de Carteira
6. Modelos de Markowitz, Sharpe e CAPM
7. Indicadores de performance de Carteiras
8. Mercado de renda fixa
9. Mercado de renda variável
10. Operações específicas de mercado
11. Mercado de derivativos: futuro, swaps e opções

DESCRIÇÃO DO PROGRAMA

1. O Sistema Financeiro Nacional
 - 1.1. Estrutura e funcionamento dos mercados monetário, crédito, capitais e cambial
 - 1.2. Principais títulos públicos e privados
 - 1.3. Principais produtos financeiros
 - 1.4. Normatização básica do mercado de capitais (Leis 4595/64; 4728/65; 6385/76 e 6404/76; 9447/97)
2. Financiamento de empresas e o mercado acionário
 - 2.1. Sociedades anônimas de capital aberto
 - 2.2. Direitos e deveres dos acionistas
 - 2.3. Governança corporativa
 - 2.4. Mercado primário (ações, debêntures – underwriting)
 - 2.5. Mercado secundário (bolsa de valores)
3. O investidor e o mercado de ações
 - 3.1. Classificação de investidores
 - 3.2. Características dos investimentos (liquidez, retorno e risco)
4. Técnicas de análise de risco, retorno e liquidez
 - 4.1. Valor do dinheiro no tempo
 - 4.2. Avaliação de obrigações e ações
 - 4.3. Eficiência informacional
 - 4.4. Retorno, risco e diversificação
 - 4.5. Análise de portfólio (montagem de carteiras de ativos)
 - 4.6. Modelo de precificação de ativos financeiros
 - 4.7. Modelo de Markowitz, Sharpe e CAPM
5. Desempenho de Carteira
 - 5.1. Métodos de Avaliação Permanente
 - 5.2. Volatilidade das Carteiras
 - 5.3. Otimização da Composição do Mix de Carteira
 - 5.4. Indicadores de performance de Carteiras
6. Mercado de Renda Fixa
 - 6.1. Características e Papel dos Títulos
 - 6.2. Características do Mercado de Renda Fixa
 - 6.3. Aspectos Operacionais
 - 6.4. Organização
 - 6.5. Análise Setorial
7. Mercado de Renda Variável
 - 7.1. Características e Papel dos Títulos
 - 7.2. Características do Mercado de Renda Variável
 - 7.3. Aspectos Operacionais
 - 7.4. Organização
 - 7.5. Análise Setorial
8. Operações Específicas do Mercado
 - 8.1. CDI
 - 8.2. Export Notes
 - 8.3. Commodities

8.4. Títulos de Conversão da Dívida Externa

9. Mercado de derivativos

9.1. Conceito, histórico e organização do mercado de derivativos

9.2. Mercado futuro e a termo

9.2.1. Precificação: relação entre preço futuro e preço à vista.

9.2.2. Estratégias de investimento em mercado futuros

9.3. Mercado de swaps

9.4. Mercado de opções

9.4.1. Características do mercado, agentes, produtos e resultados

9.4.2. Estratégias de investimentos com opções

BIBLIOGRAFIA

- ASSAF NETO, A. Mercado Financeiro. 5. ed. São Paulo: Atlas, 2003. 400p.
- BODIE, Z; MERTON, R. C. Finanças. 1. ed. rev. Porto Alegre: Bookman, 2002.
- BODIE, Z.; KANE, A.; MARCUS, A. J. Fundamentos de investimentos. 3a. ed. Porto Alegre: Bookman, 2000.
- BREALEY, R. e MYERS, S. Principles of Corporate Finance. McGraw-Hill Book Co., 1984.
- BULGARELLI, W. Manual das Sociedades Anônimas. São Paulo: Atlas, 2001.
- CNBV. Mercado de Capitais. São Paulo, 1998.
- FORTUNA, Eduardo. Mercado Financeiro: Produto e Serviços. Rio de Janeiro: Qualitymark, 1992
- GALVEAS, E. Sistema Financeiro e Mercado de Capitais. IBMEL, 1985.
- HULL, J. Introdução aos mercados futuros e de opções. São Paulo: BM&F, 2000.
- HULL, J. Opções, futuros e outros derivativos. São Paulo: BM&F, 2001.
- NETO, H. C.; SOUZA, L. A.; ROSSI, M. C. Abertura de capital de empresas no Brasil: um estudo prático. São Paulo: Atlas, 2000.
- NÓBREGA, M.; LOYOLA, G.; GUEDES FILHO, E. M.; PASQUAL, D. O mercado de capitais: sua importância para o desenvolvimento e os entraves com que se defronta no Brasil. São Paulo: BOVESPA, 2000.
- PINHEIRO, J. L. Mercado de Capitais: fundamentos e técnicas. 2a ed. São Paulo: Atlas, 2002.
- SÁ, G. Tosta. Mercado de Ações. Bolsa de Valores, RJ., Aplicação, Ed. Técnica, 1987
- Comissão Nacional de Bolsa de Valores. Introdução ao Mercado de Ações. Rio de Janeiro, C.N.B.V, 1987.
- SANVICENTE, A. Z. e MELLEGI FILHO, A. Mercado de Capitais e Estratégias de Investimentos. São Paulo, Atlas, 1987.
- SILVA NETO, L. A. Derivativos: definições, emprego e risco. São Paulo: Atlas, 2000.
- SECURATO, J. R. Decisões Financeiras em Condições de Risco. Editora Atlas, São Paulo, 1993.

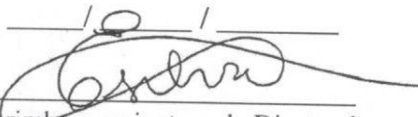
APROVAÇÃO

____/____/____

Carimbo e assinatura do Coordenador do curso

gov.br

Documento assinado digitalmente
THIAGO ALBERTO DOS REIS PRADO
Data: 27/01/2023 06:50:38-0300
Verifique em <https://verificador.iti.br>

____/____/____


Carimbo e assinatura do Diretor da
Unidade Acadêmica

UNIVERSIDADE FEDERAL DE UBERLÂNDIA
Faculdade de Administração, Ciências Contábeis,
Engenharia de Produção e Serviço Social - FACES/PPU
Prof.ª Dr.ª Editeusa da Silva
Diretora da FACES - Portaria SEI R. Nº 499/2018