

DISCIPLINA: TÓPICOS ESPECIAIS EM FINANÇAS: Processo Decisório Aplicado à Finanças	CÓDIGO: GT00FIN002.1
--	-----------------------------

VALIDADE: a partir de agosto de 2019

TÉRMINO:

Carga Horária: Total: 30 horas/aula

Semanal: 02 aulas

Créditos: 02

Modalidade: Teórica

Classificação do Conteúdo pelas DCN: Formação Complementar

Ementa:

Processo de decisão. Racionalidade dos processos de decisão: parâmetros dos problemas de decisão. Decisões multi-objetivo: análise de sensibilidade, árvore de decisão, análise de cenários, simulação de Monte Carlo. Tomada de decisão com incerteza e risco: Critérios de escolha determinística e Critérios de escolha utilizando probabilidades.

Curso(s)	Período	Eixo	Obrigatória	Optativa
Administração	5º, 6, 7º e 8º	5 – Econômico-Financeiro		X

Departamento/Coordenação: Departamento de Ciências Sociais Aplicadas (DCSA)

INTERDISCIPLINARIEDADES

Pré-requisitos	Código
- Estatística I - Matemática Financeira - O aluno deverá ter integralizado 1440 horas no curso - O aluno das Engenharias deverá ter integralizado 2610 horas de curso	
Correquisitos	
Não há	
Disciplinas para as quais é pré-requisito	
Não há	
Disciplinas para as quais é co-requisito	
Não há	

Objetivos:

- Conhecer os conceitos que irão auxiliar na estruturação e resolução de problemas.
- Conhecer as técnicas que irão proporcionar tomadas de decisão mais seguras.
- Conhecer os métodos e algumas técnicas quantitativas utilizadas para apoiar a tomada de decisão.
- Trabalhar com a simulação de problemas de tomada de decisão no âmbito das Finanças.
- Utilizar algumas ferramentas disponíveis nos softwares Excel, @Risk e Python.

Unidades de ensino	Carga-horária Horas/aula
1 INTRODUÇÃO PROCESSO DECISÓRIO	6
2 RACIONALIDADE DOS PROCESSOS DE DECISÃO	4
3 TOMADA DE DECISÃO COM INCERTEZA E RISCO	4



Plano de Ensino

4	DECISÕES MULTI-OBJETIVO	16
	4.1. Análise de sensibilidade	
	4.2. Árvore de decisão	
	4.3. Análise de cenários	
	4.4. Simulação de Monte Carlo.	
	Total	30

Bibliografia Básica

DUARTE JÚNIOR, A. M. **Gestão de riscos para fundos de investimentos**. São Paulo: Pearson Prentice Hall, 2005.

LUTZ, M. **Aprendendo Python**. Porto Alegre: Bookman, 2007.

RAGSDALE, C. T. **Modelagem de planilha e análise de decisão**. 9. ed. São Paulo: Cengage Learning, 2015.

Bibliografia Complementar

CHANKONG, V. **Multiobjective decision making: theory and methodology**. New York: Dover Publications, 2008.

CHEN, Z. **Computational intelligence for decision support**. Boca Raton: CRC Press, 2000.

HAIR, J. F.; BLACK, W. C.; BABIN; B. J. **Análise multivariada de dados**. 6. ed. Porto Alegre: Bookman, 2009.

REES, M. **Business risk and simulation modelling in practice: using Excel, VBA and @RISK**. Chichester: John Wiley & Sons, 2015.

SHARDA, Ramesh. **Business intelligence and analytics: systems for decision support**. 10. ed. Boston: Pearson, 2015.