

Plano de Ensino

CAMPUS Nova Gameleira	
DISCIPLINA: Mercado de Capitais	CÓDIGO: G00MCAP1.01

Início: **01/2023**

Carga Horária: Total: 60 horas/aula

Semanal: 04 aulas/aula

Créditos: 04

Natureza: Teórica

Área de Formação - DCN: Profissionalizante

Competências/habilidades a serem desenvolvidas (Para os cursos de Engenharia)
Departamento que oferta a disciplina: Departamento de Ciências Sociais Aplicadas

Ementa:

Introdução ao Mercado de Capitais. Estrutura e Dinâmica do Mercado de Capitais: Investidores, Mercados primário e secundário, Bolsa de Valores no Brasil, Derivativos. Análise de Ações: Análise fundamentalista e análise técnica.

Curso(s)	Período	Eixo	Obrigatória	Optativa
Administração	7º	03 – Econômico-Financeiro	X	

INTERDISCIPLINARIDADES

Prerrequisitos
Macroeconomia
Correquisitos

Objetivos: A disciplina deverá possibilitar ao estudante

1	Compreender e avaliar o ambiente econômico-financeiro que envolve as organizações no que se refere à execução das estratégias financeiras.
2	Entender como funcionam os mercados primários e secundários de ações.
3	Aprender as abordagens de avaliação de ações: análise técnica e fundamentalista.
4	Compreender a teoria e as ferramentas de gestão de carteiras.
5	Entender os modelos de precificação de ativos e os indicadores de avaliação de performance de fundos de investimento.
6	Entender como funcionam os instrumentos derivativos.

Unidades de ensino	Carga horária Horas/aula
1 Sistema Econômico e Mercados Financeiros • Importância do mercado de capitais • Funcionamento do sistema econômico-financeiro • Políticas do governo: monetária, fiscal e cambial • Estrutura do sistema financeiro nacional	06

Plano de Ensino

	• Mercados Financeiros: monetário, crédito, câmbio e capitais • Principais produtos negociados nos mercados financeiros	
2	Financiamento de Longo Prazo e o Mercado Acionário • Principais produtos financeiros do mercado de capitais • Renda fixa • Renda variável	02
3	Mercado primário de ações • Tipos de oferta pública de ações • Processo de emissão de ações: distribuição primária e secundária • Formas de subscrição de ações: garantias Mercado secundário de ações • Bolsas de Valores, sociedades corretoras, distribuidoras de títulos e valores mobiliários • Modalidades operacionais: mercado à vista, termo, futuros e opções • Índices de bolsas de valores • Mercado de balcão • Governança corporativa	04
4	Avaliação de investimento em ações Análise fundamentalista • Análise Relativa (por múltiplos de mercado) • Modelo de desconto de dividendos (MDD) • Modelo de fluxo de caixa descontado (FCD) Análise técnica • Conceitos • Tipos de Gráficos • Princípios de Dow • Suporte, resistência, tendências • Padrões de comportamento dos preços • Principais Indicadores Técnicos (rastreadores e osciladores)	24
5	Avaliação de investimento em ações • Eficiência de mercado • Teoria de portfólio: estatísticas individuais e de carteiras: diversificação • Linha do mercado de capitais (CML) • Linha do mercado de títulos (SML) x linha do mercado de capitais (CML) • Modelo de precificação de ativos de capital – CAPM • Índices de avaliação de fundos de investimento	20
6	Derivativos • Uso de derivativos: especulação e hedge • Descrição dos Instrumentos: contratos – termo, futuro, swaps e opções • Mercados Futuros e Swaps • Mercado de opções • Precificação de Opções: método de Black & Scholes	04
Total		60

Plano de Ensino

Bibliografia Básica	
----------------------------	--

- | | |
|---|--|
| 1 | ASSAF NETO, A. Mercado financeiro. 11. ed. São Paulo: Atlas, 2012. |
| 2 | BODIE, Z.; KANE, A.; MARCUS, J. A. Investimentos. 10. ed. Porto Alegre: Bookman, 2015. |
| 3 | PINHEIRO, J. L. Mercado de capitais. 8. ed. São Paulo: Atlas, 2018. |

Bibliografia Complementar	
----------------------------------	--

- | | |
|---|--|
| 1 | ABE, M. Manual de análise técnica: essência e estratégias avançadas. São Paulo: Novatec, 2009. |
| 2 | BESSADA, O.; BARBEDO, C.; ARAÚJO, G. O mercado de derivativos no Brasil: conceitos, operações e estratégias. 3. ed. Rio de Janeiro: Record, 2009. |
| 3 | DAMODARAN, A. Avaliação de investimentos: ferramentas e técnicas para a determinação do valor de qualquer ativo. 2. ed. Rio de Janeiro: Qualitymark, 2010. |
| 4 | ELTON, E.; GRUBER, M. J.; BROWN, S. J.; GOETZMANN, W. N. Moderna teoria de carteira e análise de investimentos. Rio de Janeiro: Elsevier, 2012. |
| 5 | GRINBLAT, M.; TITMAN, S. Mercados financeiros e estratégia corporativa. 2. ed. Porto Alegre: Bookman, 2005. |