

## **Pós-Graduação a distância**

### **Mercado Financeiro e de Capitais**

#### **DISCIPLINAS:**

- 1) MÉTODOS QUANTITATIVOS APLICADOS AO MERCADO FINANCEIRO E DE CAPITALIS
  - 2) ECONOMIA APLICADA AO MERCADO FINANCEIRO E DE CAPITALIS – INDICADORES ECONÔMICOS
  - 3) ESTRUTURA DO MERCADO DE CAPITALIS
  - 4) CONTABILIDADE E ANÁLISE DAS DEMONSTRAÇÕES CONTÁBEIS
  - 5) ECONOMIA INTERNACIONAL E CÂMBIO
  - 6) ANÁLISE TÉCNICA DE AÇÕES
  - 7) ANÁLISE FUNDAMENTALISTA DE AÇÕES: MÉTODO AVALIAÇÃO RELATIVA DE AÇÕES
  - 8) ANÁLISE FUNDAMENTALISTA DE AÇÕES: MÉTODO DO FLUXO DE CAIXA DESCONTADO
  - 9) INSTRUMENTOS DE RENDA FIXA
  - 10) INVESTIMENTOS NO EXTERIOR, OURO E CRIPTOMOEDAS
  - 11) MERCADO DE DERIVATIVOS
  - 12) FUNDOS DE INVESTIMENTOS E OPERAÇÕES ESTRUTURADAS
  - 13) ANÁLISE DE RISCOS E GESTÃO DE CARTEIRAS
  - 14) MERCADO DE OPÇÕES DA B3
  - 15) MÉTODOS PROGRAMAÇÃO APLICADO AO MERCADO DE CAPITALIS
  - 16) HUMANIDADES
- 
- 
-

## **EMENTAS:**

### **DISCIPLINA 1 – MÉTODOS QUANTITATIVOS APLICADOS AO MERCADO FINANCEIRO E DE CAPITAIS**

Valor presente, valor futuro, taxa de desconto e fluxo de caixa, capitalização simples e composta, taxa real, séries de pagamentos, *payback* simples e descontado, VPL, TIR, medidas de posição, medidas de dispersão e correlação, regressão linear, utilização do software Excel e da calculadora HP 12 - C.

### **DISCIPLINA 2: ECONOMIA APLICADA AO MERCADO FINANCEIRO E DE CAPITAIS – INDICADORES ECONÔMICOS**

Cenário macroeconômico nacional, política monetária, fiscal, cambial, principais indicadores econômicos, indicadores financeiros, efeito da política monetária, fiscal e cambial no mercado financeiro e de capitais.

### **DISCIPLINA 3: ESTRUTURA DO MERCADO DE CAPITAIS**

Introdução ao mercado de capitais, ativos financeiros negociados no mercado de capitais, ações, proventos, abertura de capital, mercados da B3 – mercado a vista, a termo e de opções – peculiaridades do mercado de ações brasileiro.

### **DISCIPLINA 4: CONTABILIDADE E ANÁLISE DAS DEMONSTRAÇÕES CONTÁBEIS**

Estrutura das demonstrações financeiras, balanço patrimonial, demonstração de resultado de exercício, demonstração de fluxo de caixa, análise horizontal e vertical das demonstrações contábeis, análise por índices, tomada de decisão através de índices.

### **DISCIPLINA 5: ECONOMIA INTERNACIONAL E CÂMBIO**

Sistema Financeiro Internacional, teorias de comércio internacional, fluxos Internacionais de Capitais, política econômica em economias abertas, balanço de

pagamentos, determinação da Taxa de Câmbio, o mercado de câmbio, indicadores macroeconômicos e de atividade, análise setorial e o mercado de capitais.

#### **DISCIPLINA 6: ANÁLISE TÉCNICA DE AÇÕES**

Introdução a análise técnica, teoria Dow, tipos de gráfico, *candlestick*, padrões gráficos, principais osciladores e rastreadores, *pivot*, psicologia do investidor, manejo de risco.

#### **DISCIPLINA 7: ANÁLISE FUNDAMENTALISTA DE AÇÕES: MÉTODO AVALIAÇÃO RELATIVA DE AÇÕES**

Conceito de avaliação relativa, múltiplos de patrimônio líquido, múltiplo preço/lucro, preço/VPA, dividend yield, múltiplos de empresa, EV/EBITDA, outros múltiplos, filtros de Graham.

#### **DISCIPLINA 8: ANÁLISE FUNDAMENTALISTA DE AÇÕES: MÉTODO DO FLUXO DE CAIXA DESCONTADO**

Conceito de preço e valor, viés na avaliação, estimação da taxa de desconto para o patrimônio líquido e para empresa, modelo CAPM, fluxo de caixa, perpetuidade, valor intrínseco para o patrimônio líquido e para a empresa.

#### **DISCIPLINA 9: INSTRUMENTOS DE RENDA FIXA**

Títulos Públicos: LFT, LTN, NTN-B, mercado primário e secundário, Tesouro Direto, títulos de renda fixa privados, CDB, debêntures, LCA, LCI, outros ativos de renda fixa, duration de Macaulay e duration modificada, índices do mercado de renda fixa, principais riscos no mercado de renda fixa, tributação, Fundo Garantidor de Crédito.

#### **DISCIPLINA 10: INVESTIMENTOS INTERNACIONAIS, ETF'S, COMMODITIES E CRIPTOMOEDAS**

Investimentos internacionais e Brazilian Depositary Receipts. Exchange Traded Funds: fundos de índices, fundos para nichos de mercado, commodities e criptomoedas.

Commodities: agronegócio, minerais, energia, entre outras. Evolução do dinheiro e dos meios de pagamento, criptomoedas, inovações digitais.

#### **DISCIPLINA 11: MERCADO DE DERIVATIVOS**

Conceito de mercado de derivativos, mercado a termo da B3, estratégias no mercado a termo, operação financiamento e caixa, mercado futuro, mercado futuro do Ibovespa, mercado futuro de Dólar, mercado futuro de DI, outros mercados futuros da B3, minicontratos, hedge de carteiras com mercado futuros, introdução ao mercado de opções.

#### **DISCIPLINA 12: FUNDOS DE INVESTIMENTOS E OPERAÇÕES ESTRUTURADAS**

Conceito de fundos de investimento, tipos de fundos, custos dos fundos, fundos estruturados: FII, FIP e FIDC; tributação, métricas de risco e desempenho, Sharpe, razão de Treynor e Sortino. COE.

#### **DISCIPLINA 13: ANÁLISE DE RISCOS E GESTÃO DE CARTEIRAS**

Princípios de aversão ao risco, tipos de riscos (mercado, operacional, crédito e liquidez), agências de risco, operações com carteiras, binômio risco e retorno, risco sistemático e não sistemático, fronteira eficiente, risk breakdown structure, cenários de estresse, value at risk (VAR).

#### **DISCIPLINA 14: MERCADO DE OPÇÕES DA B3**

Características do mercado de opções, opções americanas e europeias, valor intrínseco, modelo de Black and Scholes, delta, gama, theta, vega, operações com opções, travas, hedge de carteira, venda coberta.

#### **DISCIPLINA 15: MÉTODOS PROGRAMAÇÃO APLICADO AO MERCADO DE CAPITAIS**

Introdução à linguagem de programação Python. Bibliotecas para tratamento de dados. Ferramentas para obtenção de dados do mercado financeiro através da Internet. Programação financeira: cálculos para investimentos de renda fixa e de renda variável.

## **DISCIPLINA 16 - HUMANIDADES**

O ser humano, o processo de humanização e o conceito de pessoa. Desafios contemporâneos e o lugar da religião e da espiritualidade. Autonomia e heteronomia na sociedade atual. Princípios éticos e ética profissional.