

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).

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.

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.

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.

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.

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.

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.

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.

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.

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.



Especialização em Mercado Financeiro e de Capitais

OFERTA 5, TURMA 1, MODALIDADE Assíncrono

EMENTÁRIO DAS DISCIPLINAS

Investimentos no Exterior, Ouro 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.

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.

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.

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.

Métodos Quantitativos Aplicado 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.