



Plano de Atividades Domiciliares ADE

Unidade Curricular: Introdução à Engenharia Financeira

Professor(es): Renato Cesar Sato

Contato: rcsato@unifesp.br

Ano Letivo: 2021

Semestre: 1o.

Carga horária total: 72h (36 hs práticas e 36h teóricas)

Turma(s): Integral

Plataforma de acesso ao curso: Google Classroom

Objetivos (remoto):

Geral: Apresentar as principais ideias e técnicas da engenharia financeira do ponto de vista teórico e da aplicação.

Específicos: Familiarizar o aluno com conceitos relacionados a análise quantitativa de investimentos e gestão do risco de investimentos financeiros utilizando ferramentas de natureza computacional.

Conteúdo Programático e Cronograma

Semana	Conteúdo programático	Atividades/CH
1	Estruturação do ambiente computacional	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
2	Retornos: Preços dos Ativos e retornos	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
3	Retornos: Construindo uma carteira	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>



4	Risco: Desvio Padrão	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
6	Risco: Assimetria	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
6	Risco: Curtose	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
7	Teoria das Carteiras: Índice Sharpe	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
8	Teoria das Carteiras: CAPM	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
9	Teorias das Carteiras: Modelo Fama French	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
10	Aplicações: Contribuição dos Componentes para o Desvio Padrão	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
11	Aplicações: Simulação de Monte Carlo	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
12	Análise de Regressão Simples – conceitos básicos	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
13	Análise de Regressão Múltipla – conceitos básicos	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
14	Análise de Series de Tempo – conceitos básicos	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
15	Apresentação dos Trabalhos ou Técnicas aprimoradas para modelagem de dados.	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
16	Apresentação dos Trabalhos	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e</i>



		<i>assíncrono)</i>
17	Apresentação dos Trabalhos	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>
18	Apresentação dos Trabalhos	<i>Atividades práticas, leituras, exercícios (síncrono e assíncrono)</i>

Metodologia de Ensino Utilizada:

Leituras, exercícios teóricos, exercícios computacionais, encontros síncronos.

Metodologia de Avaliação (estratégias para atingir conceitos “cumprido” ou “não cumprido”) :

- Entrega das atividades atribuídas ao longo do semestre (serão 4 atividades cada uma valendo 10% da nota, isto é, as atividades valem 40% da nota). As atividades serão atribuídas na forma de exercícios ao longo do semestre.

- Apresentação do trabalho final da disciplina abordando o conteúdo teórico apresentado ao longo do semestre (60% da nota).

Será considerado aprovado o aluno que atingir nota 6,0 (60% do valor total) nas atividades acima mencionadas.

Bibliografia básica e complementar para uso remoto

Bibliografia básica e complementar para uso remoto

Bodie; Kane; Marcus. Investimentos. 10ed. AMGH 2014. (disponível on-line no Minha Biblioteca da Unifesp)

Hull, J. Opções, Futuros e Outros Derivativos. 9ed. Bookman: 2016. (disponível on-line no Minha Biblioteca da Unifesp)

Alube, F. Modelos Quantitativos em Finanças com enfoque em commodities. Bookman, 2012. (disponível on-line no Minha Biblioteca da Unifesp)

Casela,G; Berger, R. Inferência Estatística. 2.ed. Cengage, 2010. (disponível on-line no Minha Biblioteca da Unifesp)