

Campus: São José dos Campos		
Curso (s): Bacharelado Interdisciplinar em Ciência e Tecnologia		
Unidade Curricular (UC): Análise de Investimentos e Riscos		
Unidade Curricular (UC): <i>Investment and Risk Analysis</i>		
Unidade Curricular (UC): [nome da UC em espanhol - opcional]		
Código da UC: 5095		
Docente Responsável/Departamento: Renato Cesar Sato/ICT		Contato (e-mail): <i>rcsato@unifesp.br</i>
Docente (s) Colaborador/a (es/as)/Departamento (s):		Contato (e-mail): [opcional]
Ano letivo: 2022	Termo: 3	Turno/Turma:
Nome do Grupo/Módulo/Eixo da UC (se houver): Não se aplica		Idioma predominante em que a UC será oferecida: ( x ) Português ( ) English ( ) Español ( ) Français ( ) Libras ( ) Outro:
UC: ( ) Fixa ( X ) Eletiva ( ) Optativa	Oferecida como: ( x ) Disciplina ( ) Módulo ( ) Estágio ( ) Outro:	Oferta da UC: (X) Semestral ( ) Anual
Ambiente Virtual de Aprendizagem: ( X ) Moodle ( ) Classroom ( ) Outro: ( ) Não se aplica		
Pré-Requisito (s) - Indicar Código e Nome (s) da (s) UC: não há		
Carga horária total (em horas): 72		
Carga horária teórica (em horas): 30	Carga horária prática (em horas): 42	Carga horária de extensão (em horas, se houver):
Se houver atividades de extensão, indicar código e nome do projeto ou programa vinculado na Pró-Reitoria de Extensão e Cultura (ProEC):		
Ementa: Mercados Financeiros; Eficiência do Mercado; Bem Estar Social nos Mercados Livres; Análise Financeira do Valor; Custo do Capital; Modelos de Financiamentos; Análise de Carteira de Investimentos; Valor em Risco; Precificação de Opções.		
Conteúdo programático: 1. <i>Mercados Financeiros: Utilidades, Dotações e Equilíbrio</i> 2. <i>Eficiência do Mercado, Ativos Financeiros e o Fator do tempo.</i> 3. <i>Bem Estar Social e os Mercados Livres, Equilíbrio entre Consumo e Dotações, Antecipação dos Preços.</i> 4. <i>Análise Financeira do Valor: Juros Simples e Compostos, Séries de Pagamentos, Valor Presente Líquido, Taxa Interna de Retorno, Descontos</i> 5. <i>Custo do Capital: Custo Médio Ponderado do Capital,</i> 6. <i>Modelos de Financiamentos: Fluxo de Caixa e Financiamentos, Política de Dividendos.</i> 7. <i>Análise de Carteira de Investimentos: CAPM</i> 8. <i>Valor em Risco: Matriz de Variância e Co-Variância.</i> 9. <i>Precificação de Opções.</i>		
Objetivos:		
<u> Gerais:</u>		
<ul style="list-style-type: none"> <li>Familiarizar o aluno com conceitos relacionados a análise quantitativa de investimentos e gestão do risco de investimentos financeiros.</li> </ul>		
<u> Específicos:</u>		
<ul style="list-style-type: none"> <li>Aprofundar o entendimento da teoria financeira.</li> </ul>		

- Oferecer um caminho de pesquisa e aplicação dos conceitos teóricos matemáticos e computacionais para lidar com os problemas do mercado financeiro.

Metodologia de ensino:

Aulas expositivas, leituras, listas de exercícios e avaliações.

Avaliação: Serão realizadas duas provas. A média final será a média simples das duas provas.

Bibliografia:

Básica:

1. Bodie, Z.; Marcus, A.; Kane, A. Investimentos. AMGH; 10ª edição, 2014. Recurso online: Ebook
2. Hull, J. Opções, Futuros e Outros Derivativos, Bookman; 9ª edição, 2016. Recurso online: Ebook
3. Neto, A. Mercado Financeiro, Atlas, 2021. Recurso online: Ebook

Complementar:

1. Ross, Stephen, Randolph Westerfield, and Jeffrey Jaffe. Administração Financeira - Corporate Finance, New York: Irwin, Ed. Atlas, 1999.
2. Sharpe, William F., Gordon J. Alexander, and Jeffery V. Bailey. Investments, 6th edition, Upper Saddle River, NJ: Prentice Hall, 1999.
3. Benninga, S. Financial Modeling, 3.rd Edition, MIT Press, 2008.
4. Caetano, M. Python e Mercado Financeiro: Programação Para Estudantes, Investidores e Analistas, Blucher, 2021.
5. Malkiel, Burton G. Um passeio aleatório por Wall Street: Um guia clássico e abrangente para investir com sucesso, Sextante; 1ª edição, 2021.

Cronograma: *[formato semanal]*