PRÓ-REITORIA DE GRADUAÇÃO

|  |
| --- |
| PROGRAMA COMPLETO DE DISCIPLINA – 2018 |
| Unidade: Faculdade de Economia, Administração e Contabilidade de Ribeirão PretoCurso: Economia Empresarial e Controladoria |
| 1. Disciplina: Finanças II 2. Código: REC3610  |
| 3. Semestral (X)4. Anual ( ) | 5. Obrigatória (X)(Ênfase em Finanças)6. Optativa ( ) |
| 7. Disciplinas requisito ou indicação de conjunto: REC 3600 |
| 8. Créditos: 6. Semestr Ideal : 1. aula: 04
2. total: 04
 | 9. Semestre ideal: 6º10. N.º máximo de alunos por turma: 70 |
| 11. Objetivos:O curso possui os seguintes objetivos:1. Desenvolver a compreensão de como alocar de forma ótima entre alternativas de investimento arriscadas
2. Elaborar sobre o conhecimento do CAPM do semestre anterior e fornecer insights adicionais sobre como os retornos esperados são determinados
3. Examinar Estratégias de Investimento na prática
4. Desenvolver compreensão do risco em escala global
5. Construir e avaliar estratégias de investimento
 |
| 12. Conteúdo:1 – Investimento em Ativos de Renda Variável – Características Institucionais2 – Teoria de Carteiras3 – Modelos de Risco e Retorno Esperado; Eficiência de Mercado na Prática4 – Títulos de Renda Fixa5 – Introdução ao mercado de Futuros e Opções6 – Estratégias Aplicadas de Investimento e Avaliação de Desempenho7 – Diversificação Internacional  |
| 13. Avaliação:O discente será submetido ao seguinte conjunto de avaliações:1 - Duas provas com pesos 3 e 6, respectivamente; 2 – Um trabalho a ser entregue ao final do curso com as características detalhadas no STOA1. O peso do trabalho na média final é igual a 4.

3 - A nota final do curso é a média geométrica ponderada dos resultados das avaliações acima. |
| 14. Bibliografia básica:Bodie, Z. Kane, A. e Marcus, A. J. (2008). *Investments*. 10a edição. New York: McGraw Hill Irwin.Assaf Neto, A. e Lima, F. G.(2008). *Investimento em ações*. Ribeirão Preto: *Inside Books*.Brown, K. C. (2009). *Analysis of Investments and Management of Portfolios.* 9a. Edição. South-Western CENGAGE Learning.Duarte Júnior, A. M. (2005). Gestão de riscos para fundos de investimento. São Paulo: Pearson Prentice Hall.Fabozzi, Frank J. (1996). *Bond Markets, Analysis and Strategies*. Prentice Hall: New Jersey.Ross, Stephen A., Westerfield, Randolph W. & Jaffe, Jeffrey (2008). *Corporate Finance*. 8a. Edição. New York: McGraw Hill Irwin.Sharpe, William F, Gordon, Alexander J. & Bailey, Jeffrey V. (1999). *Investments*. 6ª. Edição. Prentice Hall: New Jersey. |
| 15. Docenteresponsável: Prof. Dr. Cláudio Ribeiro de Lucinda. |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Aula** | **Data** | **Assunto** | **Tipo de Aula** | **Bibliografia**  |
| 1 | 26/2/2018 | Características Institucionais do Investimento em Renda Variável | Aula | TBA |
| 2 | 2/3/2018 | Características Institucionais do Investimento em Renda Variável | Aula | TBA |
| 3 | 5/3/2018 | Risco e Retorno: Apsectos Estatísticos | Aula | BKM, cap. 05 |
| 4 | 9/3/2018 | Aversão ao Risco e Alocação de Capital em Ativos Arriscados | Aula | BKM, cap. 06 |
| 5 | 12/3/2018 | Portifólios Arriscados Ótimos | Aula | BKM, cap. 07 |
| 6 | 16/3/2018 | Modelos de Índice | Aula | BKM, cap. 08 |
| 7 | 19/3/2018 | Modelos de Índice | Aula | BKM, cap. 08 |
| 8 | 23/3/2018 | O CAPM | Aula | BKM, cap. 09 |
| 9 | 2/4/2018 | CAPM (2) | Aula | BKM, cap. 09 |
| 10 | 6/4/2018 | APT e modelos multifatoriais | Aula | BKM, cap. 10 |
| 11 | 9/4/2018 | APT e modelos multifatoriais | Aula | BKM, cap. 10 |
| 12 | 13/4/2018 | Eficiência de Mercado | Aula | BKM, cap. 11 |
| 13 | 16/4/2018 | Eficiência de Mercado | Aula | BKM, cap. 11 |
| 14 | 20/4/2018 | Finanças Comportamentais e Análise Técnica | Aula | BKM, cap. 12 |
| 15 | 23/4/2018 | Prova Intermediária | Aula | Tudo até o momento |
| 16 | 27/4/2018 | Finanças Comportamentais e Análise Técnica | Aula | BKM, cap. 12 |
| 17 | 4/5/2018 | Renda Fixa: Preços, Yields e Estrutura a Termo | Aula | BKM, 14 e 15 |
| 18 | 7/5/2018 | Renda Fixa: Preços, Yields e Estrutura a Termo | Aula | BKM, 14 e 15 |
| 19 | 11/5/2018 | Gerenciando carteiras de renda fixa | Aula | BKM, 16 |
| 20 | 14/5/2018 | Gerenciando carteiras de renda fixa | Aula | BKM, 16 |
| 21 | 18/5/2018 | Política de Investimento | Aula | BKM, cap. 26 |
| 22 | 21/5/2018 | Política de Investimento | Aula | BKM, cap. 26 |
| 23 | 25/5/2018 | Avaliação de Desempenho | Aula | BKM, cap. 24 |
| 24 | 28/5/2018 | Avaliação de Desempenho | Aula | BKM, cap. 24 |
| 25 | 4/6/2018 | Diversificação Internacional | Aula | BKM, cap. 25 |
| 26 | 8/6/2018 | Diversificação Internacional | Aula | BKM, cap. 25 |
| 27 | 11/6/2018 | Teoria de Gestão Ativa de Carteiras | Aula | BKM, cap. 27 |
| 28 | 15/6/2018 | Teoria de Gestão Ativa de Carteiras | Aula | BKM, cap. 27 |
| 29 | 18/6/2018 | Mercado de Opções: Introdução | Aula | BKM, cap. 20 |
| 30 | 22/6/2018 | Avaliação de Opções | Aula | BKM, cap. 21 |
| 31 | 25/6/2018 | Mercados Futuros e a Termo | Aula | BKM, cap. 22 |
| 32 | 30/6/2016 | Prova Final | Aula | Tudo a partir da 1a prova |