

PROGRAMA COMPLETO DE DISCIPLINA

Unidade: FACULDADE DE ECONOMIA, ADMINISTRAÇÃO E CONTABILIDADE DE RIBEIRÃO PRETO.

Curso: CIÊNCIAS CONTÁBEIS E ECONOMIA EMPRESARIAL E CONTROLADORIA

1. Disciplina: Análise de Risco

2. Código: RCC8400

3. Semestral (x)

5. Obrigatória ()

4. Anual ()

6. Optativa (X)

7. Disciplina requisito ou indicação de conjunto: -

8. Créditos :

9. Semestre Ideal:

a) aula :

b) trabalho :

c) total :

10. N.º máximo de alunos por turma: -

11. Objetivos:

1. Aperfeiçoar e aprofundar o entendimento dos conceitos e dos instrumentos utilizados nos mercados de capitais.
2. Apresentar os conceitos teóricos e práticos básicos para um adequado entendimento do risco e de sua mensuração, dentro da chamada moderna teoria de finanças.
3. Estabelecer uma visão crítica do dilema risco e retorno nos investimentos em mercado financeiro, e munir os alunos das ferramentas matemáticas básicas para a tomada de decisões em condições de risco.

12. Conteúdo Programático

- 1 – Risco no contexto de ativos de renda variável e carteira de investimentos;
- 2 – Risco no contexto de ativos de renda fixa;
- 3 – Risco no contexto de projetos de investimentos;
- 4 – Derivativos e riscos de investimentos: Mercados a termo e mercados futuros;
- 5 – Mercado de opções de ações;
- 6 – Gestão de Risco de Crédito e Risco Operacional;
- 7 – Modelos de gestão do risco de mercado;
- 8 – *Value-at-Risk*: VaR paramétrico e VaR histórico.

13. Métodos utilizados: Aulas expositivas com exercícios de fixação e provas.

14. Atividades discentes: Exercícios práticos e provinhas.

15. Carga horária semestral: 60 hs

Aulas teóricas: 50%

Aulas práticas: 50%

Seminários:

Outros:

16. Carga horária anual:

Aulas teóricas:

Aulas práticas:

Seminários:

Outros:

17. Critérios de avaliação de aprendizagem:

A disciplina terá 2 avaliações individuais (as datas das provas podem ser alteradas de acordo com o andamento do programa e as alterações, se houver, serão comunicadas com antecedência). As avaliações serão individuais, sem consulta e com uso permitido da calculadora. O conteúdo das provas é acumulativo. Outro critério de avaliação refere-se ao(s) trabalho(s) solicitado(s) a partir de temáticas pertinentes da disciplina.

a) Critério de cálculo da média final:

40% Prova 1

40% Prova 2

20% Trabalho(s)

b) Será aprovado o aluno que conseguir média final (MF) igual ou superior a 5,0 e frequência mínima de 70%.

18. Normas de recuperação: Frequência mínima de 70% e média final igual ou superior a 3,00 e inferior a 5,00 possibilita prova de recuperação. Prova de recuperação com todo conteúdo trabalhado na disciplina. Será aplicada uma prova de reavaliação dentro do prazo regimental. A nota de recuperação será calculada pela fórmula $AR = (A + R) / 2$, onde A é a nota de aproveitamento do semestre e R é a nota da prova de reavaliação.

19. Bibliografia

Bibliografia básica:

1. LIMA, Fabiano Guasti. Análise de Riscos. 2 ed. São Paulo: Atlas, 2018.

Bibliografia complementar:

2. JORION, Philippe. Financial Risk Management. 5. ed. John Wiley & Sons, 2009.
3. JORION, Philippe. Value at Risk.
4. ALEXANDER, Carol. The Handbook of Risk Management and Analysis. John Wiley & Sons, 2001
5. ASSAF NETO, Alexandre, LIMA, Fabiano Guasti. Investimentos no mercado financeiro usando a calculadora Financeira HP 12C. 2.ed. Ribeirão Preto: Inside Books Editora, 2008.
6. BRITO, Osias. Gestão de riscos: uma abordagem orientada a riscos operacionais. São Paulo: Saraiva, 2007.
7. CATELLANO, Murilo. Gestão de riscos por meio de derivativos. São Paulo: Atlas, 2009.
8. DAMODARAN, Aswath. Gestão estratégica de risco. Porto Alegre, 2009.
9. HULL, John. Introdução aos mercados futuros e de opções. 4. Ed. BM&F e Cultura Editores Associados, 2005
10. KIMURA, Herbert, SUEN, Alberto Snayuan, PERERA, Luiz Carlos Jacob, BASSO, Leonardo Fernando Cruz. Value at Risk: como entender e calcular o risco pelo VaR. Ribeirão Preto: Inside Books, 2008.
11. MARINS, André. Mercados derivativos e Análise de Risco. V.1. e v. 2. Rio de Janeiro: AMS Editora, 2004.
12. SECURATO, José Roberto. Decisões Financeiras em Condições de Risco. 2. Ed. São Paulo: Saint Paul, 2007.

20. Professor responsável: Prof. Bruno Figlioli

E-mail: figlioli@usp.br

Sala 77 bloco C1