**RCC8400- ANÁLISE DE RISCOS**

**TRABALHO**

1. Selecione, ao seu critério, entre cinco e dez ações listadas na Bolsa de Valores brasileira (Brasil, Bolsa, Balcão- B3), no sentido de analisar e indicar portfólios de investimentos;
2. O Relatório preenchido deve ser postado no ambiente edisciplinas e deve contemplar os seguintes tópicos:
3. Sumário Executivo com as recomendações de investimentos;
4. Breve descrição das empresas e ações escolhidas previamente para a análise;
5. Análise de risco-retorno para cada um dos ativos analisados;
6. Análise de portfólios (risco-retorno) considerando três perfis de aversão ao risco: i) baixo; ii) médio e iii) elevado;
7. Outras informações pertinentes à análise dos ativos individuais e portfólios, como o Value at Risk (VaR).
8. Para responder às questões propostas no trabalho, o aluno poderá utilizar diversas fontes para a coleta dos dados contábeis e de mercado, tais como:

* Comissão de Valores Mobiliários (CVM): [www.cvm.gov.br](http://www.cvm.gov.br)
* Bolsa de Valores Brasileira (Brasil, Bolsa, Balcão- B3): [www.b3.com.br](http://www.b3.com.br)
* Endereço eletrônico das companhias selecionadas;
* Outras fontes de dados poderão ser empregadas para a coleta de dados desde que pertinentes aos objetivos propostos do trabalho.

1. É de responsabilidade do aluno/grupo tanto a coleta como a análise e interpretação dos dados contábeis e de mercado. Por exemplo, fica a critério do aluno/grupo a escolha da periodicidade (diária, semanal, mensal), bem como a definição do período de análise para o processo de coleta de dados.
2. Além da entrega do relatório no ambiente edisciplinas, o aluno/grupo apresentarão os principais resultados encontrados, principalmente, com relação às indicações de investimentos.
3. O grupo pode ser formado por até cinco membros;
4. É expressamente proibido qualquer tipo de plágio.

**Data de Entrega e Apresentação:** O Relatório deve ser postado no ambiente edisciplinas até às 23:59h do dia 26/10 (quarta-feira). As apresentações dos Relatórios ocorrerão a partir do dia 27/10.