

PROGRAMA DE DISCIPLINA

Disciplina MERCADO DE CAPITAIS E DERIVATIVOS				Código ENP 564	
Departamento Departamento de Engenharia de Produção			Unidade ICEA		
Carga Horária Semanal	Teórica 04	Prática 00	Nº de Créditos 04	Duração/Semana 18	Carga Horária Semestral 60h ou 72 hora/aula

Ementa

Conceitos usuais do mercado de capitais e financeiros. Legislação, Sistema de distribuição e instituições. Descrição dos Contratos Derivativos. Metodologias de Avaliações: Modelo Binomial (CRR) e o de Black&Scholes. Precificação por Simulação. Formação de Portfólios.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

1. CONCEITOS USUAIS DO MERCADO DE CAPITAIS E FINANCEIROS

- a. Economia e finanças no começo do século XXI
- b. Sistema financeiro nacional
- c. A Nova Bolsa do Brasil
- d. Legislação, Sistema de distribuição e instituições.

2. FINANÇA EMPRESARIAL E CAPITALIZAÇÃO DA EMPRESA

- a. A administração de investimentos e o investidor
- b. Objetivos da administração das companhias
- c. Financiamento via capitalização
- d. A IPO

3. TÍTULOS

- a. Descrição dos Contratos Derivativos.
- b. Opções.

4. METODOLOGIAS DE AVALIAÇÕES

- a. Modelo Binomial (CRR).
- b. Modelo de Black&Scholes.
- c. Precificação por Simulação.
- d. Formação de Portfólios.

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

1. CAVALCANTE, F.; MISUMI, J. Y.; RUDGE, L. F. MERCADO DE CAPITAIS. Rio de Janeiro: Campus, 7ª ED, 2008.
2. HULL, J. C. Options, Futures, and Other Derivatives. Prentice Hall, 8th ed., 2011.
3. GLASSERMAN, P. **Monte Carlo Simulation in financial engineering**. Springer, 1st ed., 2003.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

1. GITMAN, L. J. **Princípios de administração financeira**. São Paulo : Pearson Education do Brasil : Addison Wesley, 2004.
2. SHREVE, S. E. **Stochastic Calculus for Finance I: The Binomial Asset Pricing Model**. Springer, 1st ed., 2005.
3. SHREVE, S. E. **Stochastic Calculus for Finance II: Continuous-Time Models**. Springer, 1st ed., 2004.
4. TSAY, R. S. **Analysis of Financial Time Series**. Wiley, 3rd ed., 2010.
5. LUENBERGUER, D. G. **Investment Science**. Oxford University Press, New York, 1997.