



Disciplina: __Mercado de Capitais_____

Professor(a): _____Flávia Vital Januzzi_____

PROGRAMA

Objetivo

A área de mercado de capitais acaba por representar um importante segmento dentro dos estudos acadêmicos em Finanças, passível de desenvolvimento de várias pesquisas dentro do escopo de renda fixa, fundos de investimentos, ações e derivativos. Tais aspectos serão explorados na disciplina de forma aplicada a fim de trazer novas temáticas para subsidiar o desenvolvimento das dissertações dos mestrandos do programa.

Ementa

Discussão teórico/ prática de títulos públicos e privados, mercado de ações com aplicação de otimização de carteiras, conceitos e estratégias de investimento associados a derivativos, conceitos e análises aplicadas a fundos de investimento (com a discussão e aplicação de modelagem em painel no R).

Conteúdo resumido em tópicos

- a) Mercado de Renda fixa (títulos públicos e privados, fundos de investimento);
- b) Mercado de Renda Variável (ações, derivativos, fundos de investimento)
- c) Introdução à modelagem em painel

Critérios de avaliação

Duas provas de 30 pontos cada (Total 60 pontos);
- Um seminário com valor de 20 pontos e um exercício/ artigo no valor de 20 pontos

Bibliografia básica

- DANA,S., LONGUINI,M. Em busca do Tesouro Direto: Um Guia Para Investir Em Títulos Públicos.2ed. São Paulo: Benvirá, 2015.
- ELTON, E. J., GRUBER M. J.,BROWN S. J., GOETZMAN W. N. Moderna Teoria de Carteiras e Análise de Investimentos. Rio de Janeiro: Elsevier, 2012.
- FABOZZI, F. J. Mercados, Análise e Estratégias de Bônus: Títulos de Renda Fixa. 1ed. Rio de Janeiro: Qualitymark, 2000.
- FERREIRA, L. F. R. Mercado de Opções : A Estratégia Vencedora. 1ed. São Paulo: Saraiva, 2010.
- GUJARATI, D. N., PORTER, D. C. Econometria Básica. 5.ed. Mc Graw Hill, 2011.
- LIMA,I. S., LIMA,G. A. S. F.,PIMENTEL,R. Curso de Mercado Financeiro. 2ed. São Paulo: Atlas, 2012.
- PINHEIRO,J. L. Mercado de Capitais. 8 ed. São Paulo: Atlas, 2016.



Bibliografia complementar

AGARWAL, Vikas; GAY, Gerald D.; LING, Leng. Window dressing in mutual funds. *Review of Financial Studies*, v. 27, n. 11, p. 3133-3170, 2014.

ALEXANDER, Carol; SHEEDY, Elizabeth. *The professional risk manager's handbook: a comprehensive guide to current theory and best practices*. PRIMIA Publications:Wilmington, 2004.

BALTAGI, Badi H. *Econometric Analysis of Panel Data*. 2th.ed. Baffins Lane: Jonh Wiley&Sons, 2001.

CHEN, Yong. Derivatives use and risk taking: evidence from the hedge fund industry. *Journal of Financial and Quantitative Analysis*, v. 46, n. 04, p. 1073-1106, 2011.

HEIJ, Christiaan; BOER, Paul; FRANSES, Philip H.; KLOEK, Teun; DIJK, Herman K. V. *Econometric methods with applications in business and economics*. New York: Oxford, 2004.

MARKOWITZ, H. Portfolio Selection. *The Journal of Finance*, vol. 7, no. 1, p. 77-91, 1952