



## Ficha 2 (variável)

Disciplina: <b>Mercado de Capitais</b>		Código: SC043				
Natureza: ( X ) Obrigatória ( ) Optativa	( x ) Semestral	( ) Anual	( ) Modular			
Pré-requisito: Análise de demonstrações Contábeis	Co-requisito:	Modalidade: ( ) Presencial ( ) Totalmente EaD ( ) _____ *C.H.EaD				
<b>CH Total: 60</b> <b>CH semanal: 04</b>	Padrão (PD): 60	Laboratório (LB): 00	Campo (CP): 00	Estágio (ES): 00	Orientada (OR): 00	Prática Específica (PE): 00
Estágio de Formação Pedagógica (EFP): 0	Extensão (EXT): 0	Prática como Componente Curricular (PCC): 00				
<b>EMENTA</b>						
Bolsa de Valores. Montagem de Carteiras: a matemática e estatística de montagem de carteiras; A diversificação de carteiras; Volatilidade histórica, implícita e condicionada; Gerenciamento de Riscos; Estratégias de investimento em opções. Mercado Futuros e a termo: precificações nos mercados; Estratégias de investimentos em mercados futuros.						
<b>PROGRAMA</b>						
Sistema Financeiro; Definições; Tipos de Mercado; Mercado de Capitais: Mercado Primário e Secundário; Sistema Financeiro Nacional; Organograma do Sistema Financeiro Nacional; Conselho Monetário Nacional (CMN); Sistema Financeiro Nacional completo; Banco Central do Brasil: Constituição e atribuições; Comissão de Valores Mobiliários: Constituição e atribuições; Histórico de Bolsa de Valores; Sistemas e Processos; Tipos de Negociação;						
Noções de risco e retorno para Fundos de Investimentos, Ações e Índices de Mercado; Objetivo geral; Horizonte, segurança e liquidez; Risco e incerteza; Características do fundo de investimento analisado; Risco e Retorno: noções; Risco e retorno: medidas de estatística descritiva; Acesso ao Yahoo Finanças; Atividade: avaliando a ação PETR4; Estatísticas de Carteiras; Risco e Retorno: associação (inicial); Risco e Retorno: associação; Risco e Retorno: Covariância; Risco e Retorno: Correlação; VAR Paramétrico e VAR histórico; Média, Variância e desvio padrão para uma carteira <i>com dois ativos com risco</i> ; Fronteira eficiente e Diversificação: o papel da correlação entre ativos; Média, Variância e desvio padrão para uma carteira <i>com até 4 ativos com risco</i> ; Utilização do SOLVER para minimização do Risco de Carteiras com múltiplos ativos; Regressão Linear Simples para determinação do coeficiente Beta.						
Métodos de Apreçamento de Ativos de Capital e sua utilização como "Taxa de Desconto"; Contextualização e objetivo do módulo; CAPM e suposições; Reta do Mercado de Capitais; Coeficiente Beta; Fórmula (final) do modelo CAPM com exemplo; Determinantes do Coeficiente beta;						
Opções de Ações: Definições; Tipos de Contrato; Histórico; Riscos do uso temerário de derivativos; Gerações de tipos de contrato (produtos); Opções: Americanas e Europeias.						
<b>OBJETIVO GERAL</b>						
Oferecer elementos teóricos, práticos e metodológicos para estudo do conteúdo programático de tópicos de Mercado de Capitais.						
<b>OBJETIVOS ESPECÍFICOS</b>						
apresentar os aspectos gerais sobre a Bolsa de Valores Brasileira; Propiciar uma visão geral do funcionamento do mercado de capitais; Discutir elementos que influenciam a montagem de carteira de ativos;						



### PROCEDIMENTOS DIDÁTICOS

As atividades da disciplina serão desenvolvidas de forma síncrona e assíncrona.

As atividades síncronas consistirão em aulas ao vivo, por meio da utilização de ferramenta de videoconferências Teams do Pacote Microsoft Office 365 da UFPR. Para tanto, será criada uma equipe do Teams relativa à disciplina. Nas datas e horários agendados, o professor apresentará o conteúdo programado para dia. A fim de garantir total acesso ao conteúdo, as aulas serão gravadas e disponibilizadas na Sala de Aula da disciplina, que será criada na ferramenta educacional Teams (Plataforma oficial Teams UFPR).

As aulas ao vivo da disciplina ocorrerão às quartas (das 18:30 as 20:30) e sextas (das 18:30 as 20:30), com carga horária de 2 horas/aula,

	<b>Turma A</b>	<b>Turma B</b>
Quarta-Feira	18:30 a 20:30 (Síncrono)	20:30 a 22:30 (Assíncrono)
Sexta-Feira	20:30 a 22:30 (Assíncrono)	18:30 a 20:30 (Síncrono)

Já as atividades assíncronas consistirão na resolução domiciliar de exercícios solicitados pelo professor.

Todos materiais de apoio da disciplina serão disponibilizados no Teams (Plataforma oficial Teams UFPR).

As atividades avaliativas da disciplina deverão ser entregues nas datas estipuladas no Cronograma de Atividades.

### FORMAS DE AVALIAÇÃO

A frequência será auferida com base na entrega dos exercícios solicitados pelo professor da disciplina.

A avaliação por nota será feita por meio de 2 (duas) atividades avaliativas domiciliares, conforme cronograma. A nota da avaliação será atribuída em escala de 0 (zero) a 80 (oitenta), cada. Além disso, serão aplicados 06 (seis) atividades que valerão no máximo 20 (vinte) pontos, cada.

Os períodos para realização e prazo máximo para entrega de cada avaliação estão descritos no cronograma de atividades.

Não serão aceitas atividades entregues fora dos prazos estipulados no cronograma. A não entrega da atividade acarretará em nota 0 (zero).

A nota da disciplina consistirá na média aritmética simples das notas obtidas nas 2 (duas) atividades avaliativas adicionadas das atividades. A nota para aprovação é 70. A nota mínima para qualificação para o Exame Final é 40. A nota para aprovação no Exame Final é 50.

O exame final da disciplina será individual e de forma assíncrona. O exame final ocorrerá no dia 22/12/2021.



### BIBLIOGRAFIA BÁSICA

FORTUNA, Eduardo. **Mercado financeiro: produtos e serviços**. 21 Ed. São Paulo: Qualitymark, 2011.

ANDREZO, Andrea Fernandes; LIMA, Iran Siqueira. **Mercado financeiro: aspectos históricos e conceituais**. 1 Ed. Pioneira, 2000.

ASSAF, NETO. Mercado financeiro. 10 ed. **São Paulo: Atlas**, 2011.

PINHEIRO, Juliano Lima. **Mercado de capitais: fundamentos e técnicas**. 8 Ed. São Paulo: Atlas, 2018.

### BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

LAGIOIA, Umbelina Cravo Teixeira. **Fundamentos do mercado de capitais**. 2 Ed. São Paulo: Atlas, 2007.

NETO, Alexandre Assaf; LIMA, Fabiano Guasti. **Investimento em ações: guia teórico e prático para investidores**. 1 Ed. São Paulo: Inside Books, 2008.

MELLAGI FILHO, Armando. ISHIKAWA, Sérgio. Mercado financeiro e de Capitais. 2 Ed. São Paulo: Atlas, 2003.

KERR, Roberto. **Mercado Financeiro e de Capitais**. 1 Ed. Sao Paulo: Pearson, 2015.

BERNSTEIN, Peter. A história do mercado de capitais. **O impacto da ciência e da tecnologia**. 1 Ed. Rio de janeiro: Campus, 2008.

LIMA, Iran Siqueira; LIMA, G. A. S. F.; PIMENTEL, Renê Coppe. Curso de mercado financeiro–tópicos especiais. 2. Ed. **São Paulo: Atlas**, 2009.

**Professor da Disciplina: CLAUDIO MARCELO EDWARDS BARROS**

**Assinatura:** \_\_\_\_\_

**Chefe de Departamento ou Unidade equivalente: LUCIANO MÁRCIO SCHERER**

**Assinatura:** \_\_\_\_\_



**SC445 – MERCADO DE CAPITAIS**  
**OFERTA EM ENSINO REMOTO EMERGENCIAL**  
**CRONOGRAMA DETALHADO DE ATIVIDADES**

<b>Atividade</b>	<b>Data</b>	<b>Tipo de Atividade</b>	<b>Horário</b>	<b>Carga horária</b>	<b>Descrição de atividades</b>	<b>Recurso de Comunicação/Interação</b>
1	22/09/2021	Síncrona	18:30 até 20:30	2	Apresentação da disciplina;	Teams
2	24/09/2021	Assíncrona	20:30 até 22:30	2	Interpretação de indicadores contábeis, múltiplos de desempenho e múltiplos de valoração para análises de ações de cias listadas em bolsas de valores;	Teams
3	29/09/2021	Síncrona	18:30 até 20:30	2	Sistema Financeiro Nacional (SFN); Exemplos do cotidiano do mercado financeiro;	Teams
4	01/10/2021	Assíncrona	20:30 até 22:30	2	Objetivos do Conselho Monetário Nacional (CMN); Exemplos de deliberações do CMN; <b>Atividade 1:</b> Primeiro relatório da competição de carteiras; (entrega/postagem até 01/10/2021 no Teams)	Teams
5	06/10/2021	Síncrona	18:30 até 20:30	2	SFN Completo Noções sobre Política Monetária e Banco Central (BACEN) Tesouro Nacional	Teams
6	08/10/2021	Assíncrona	20:30 até 22:30	2	Atribuições do BACEN (Parte 1)	Teams
7	13/10/2021	Síncrona	18:30 até 20:30	2	Atribuições do BACEN (Parte 2) Modelo IS-LM (Investment/Save – Liquidity/Money)	Teams
9	15/10/2021	Assíncrona	20:30 até 22:30	2	Atribuições da Comissão de Valores Mobiliários (CVM)	Teams
10	20/10/2021	Síncrona	18:30 até 20:30	2	<b>Atividade 2:</b> Disponibilização de lista de exercícios para resolução individual (entrega/postagem até 22/10/2021 no Teams)	Teams
11	22/10/2021	Assíncrona	20:30 até 22:30	2	<b>Bolsa de Valores:</b> Definição; Valores Mobiliários; O que não são Valores Mobiliários; O que não é Bolsa de Valores; Natureza jurídica das Bolsas de Valores;	Teams
12	27/10/2021	Síncrona	18:30 até 20:30	2	<b>Bolsas de Valores:</b> Objetivo Socioeconômico das Bolsas e Valores; Fontes de Financiamento; Ações; Desdobramentos ( <i>Splits</i> ) e Grupamentos ( <i>Inplits</i> );	Teams



13	29/10/2021	Assíncrona	20:30 até 22:30	2	<b>Bolsas e Valores:</b> Prospectos; Índices de ações; Formas de Negociação;	Teams
14	03/11/2021	Síncrona	18:30 até 20:30	2	<b>Atividade 3:</b> Disponibilização de lista de exercícios para resolução individual (entrega/postagem até 05/11/2021 no Teams)	Teams
15	05/11/2021	Assíncrona	20:30 até 22:30	2	<b>Encaminhamento da Avaliação 1</b>	Teams
16	17/11/2021	Síncrona	18:30 até 20:30	2	Horizonte, Segurança e Liquidez em investimentos financeiros de renda fixa ou variável;  Análise qualitativa de um fundo de renda fixa e um fundo de ações;	Teams
17	19/11/2021	Assíncrona	20:30 até 22:30	2	Risco e Retorno: medidas de estatística de carteira (parte 1: definições de medidas univariadas)	Teams
18	24/11/2021	Síncrona	18:30 até 20:30	2	Risco e Retorno: medidas de estatística carteira (parte 2: aplicações e exemplos)	Teams
19	26/11/2021	Assíncrona	20:30 até 22:30	2	<b>Atividade 4:</b> Disponibilização de lista de exercícios para resolução individual (entrega/postagem até 29/11/2021 no Teams)	Teams
20	01/12/2021	Síncrona	18:30 até 20:30	2	Risco e Retorno: medidas de estatística de carteira (parte 1: definições de medidas bivariadas)	Teams
21	03/12/2021	Assíncrona	20:30 até 22:30	2	Risco e Retorno: medidas de estatística de carteira (parte 2: aplicações e exemplos)	Teams
22	08/12/2021	Síncrona	18:30 até 20:30	2	Risco e Retorno: medidas de estatística de carteira (parte 3: Coeficiente Beta)	Teams
23	10/12/2021	Assíncrona	20:30 até 22:30	2	Valor em risco paramétrico	Teams
24	15/12/2021	Assíncrona	18:30 até 20:30	2	<b>Encaminhamento da Avaliação 2</b>	



Ministério da Educação  
UNIVERSIDADE FEDERAL DO PARANÁ  
Setor de Ciências Sociais Aplicadas  
Curso de Ciências Contábeis

## Quadro de Identificação do Docente

Disciplina:	<b>SC043 – MERCADO DE CAPITAIS</b>		
Quantidade de turmas que serão ofertadas	1	Quantidade de vagas por turma	60
Docente responsável	Claudio Marcelo Edwards Barros		
e-mail para contato	<a href="mailto:claudiomedwards@hotmail.com">claudiomedwards@hotmail.com</a>		