



UNIVERSIDADE FEDERAL DE SÃO CARLOS

Campus Sorocaba

Centro de Ciências em Gestão e Tecnologia

Coordenação do Curso de Ciências Econômicas

Rodovia João Leme dos Santos (SP 264), Km 110

Bairro: Itinga - Sorocaba - São Paulo - Brasil - CEP: 18052-780

Fone: (15) 3229-5949

MERCADOS DE CAPITAIS E DE DERIVATIVOS - 496120

I – DEPARTAMENTO DE OFERTA: Departamento de Economia – DEc-So

II – CARGA HORÁRIA: 60h / 4 créditos

III – PERFIL DE OFERTA / CARÁTER: 6º perfil / optativa

IV – REQUISITOS: “Econometria 1” e “Matemática Financeira”.

V – OBJETIVOS: Entender de forma teórica e prática o funcionamento dos mercados de capitais e de derivativos. Fornecer ferramentas para análise e acompanhamento destes mercados, bem como discutir estratégias que possam ser utilizadas para administração de riscos de preços.

VI – EMENTA: Mercado e Títulos Financeiros; Formação de Carteiras de Investimentos; Avaliação de Títulos; Derivativos: Mercado a Termo, de Futuros, Swaps e Opções; Modelos de Precificação.

VII – BIBLIOGRAFIA BÁSICA

- ASSAF NETO, A. Mercado financeiro. 8 ed. São Paulo: Atlas, 2008.
- DAMODARAN, A. Gestão estratégica do risco: uma referência para a tomada de riscos empresariais. Porto Alegre: Bookman, 2009.
- ELTON, E. J.; GRUBER, M. J.; BROWN, S. J.; GOETZMANN, W. N. Moderna Teoria de Carteiras e Análise de Investimentos. São Paulo: Atlas, 2004.
- HULL, J. Fundamentos dos mercados futuros e de opções. Tradução de M.A. Teixeira. 4. ed. São Paulo: Bolsa de Mercadorias & Futuros, 2005. 340 p.
- INGERSOLL, J.E. Theory of financial decision making. Maryland: Rowman & Littlefield Publishers Inc., 1987. 449 p.
- HARDAKER, J. B.; HUINER, R. B. M.; ANDERSON, J. R.; LIEN, G. Coping risk with agriculture. Cambridge, MA: CABI Publishing, 2004. 332 p.



UNIVERSIDADE FEDERAL DE SÃO CARLOS

Campus Sorocaba

Centro de Ciências em Gestão e Tecnologia

Coordenação do Curso de Ciências Econômicas

Rodovia João Leme dos Santos (SP 264), Km 110

Bairro: Itinga - Sorocaba - São Paulo - Brasil - CEP: 18052-780

Fone: (15) 3229-5949

- LEUTHOLD, R.M.; JUNKUS, J.C.; CORDIER, J.E. The theory and practice of futures markets. Lexington: Lexington Books, 1989. 410 p.