

OFÍCIO CIRCULAR Nº 36/2021/GABINETE/PROGRAD/UFES

PLANO DE ENSINO			
Universidade Federal do Espírito Santo Campus: Goiabeiras			
Curso: ADMINISTRAÇÃO			
Departamento Responsável: Administração			
Data de aprovação (Art. Nº 91):			
DOCENTE PRINCIPAL: Rita de Cassia Zuccolotto			
Qualificação/link para o Currículo Lattes: Mestre em Ciências Contábeis http://lattes.cnpq.br/3983269517277144			
Disciplina: Tópicos Avançados I em Finanças Código: ADM11015			
Período: 8º.		Turma: 1	
Pré-requisito:		Carga Horária Semestral: 60 horas	
Créditos:	Distribuição da Carga Horária Semestral		
	Teórica	Exercício	Laboratório
	60	0	0
Ementa: Estudos especiais em Mercados Financeiros, de relevância para a formação acadêmica do aluno em sua respectiva área de concentração de estudos. Estes estudos específicos visam a permitir a permanente atualização na área, através de temas não contemplados em outras disciplinas.			
Objetivos Específicos: Desenvolver os conceitos básicos e avançados de administração financeira necessários para obtenção da certificação profissional ANBIMA (Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiros e de Capitais) CPA-10, nova certificação C-Pro I, a partir de janeiro de 2026, estimulando o estudo em finanças sob perspectivas diferenciadas e enfoques quantitativos, qualitativos e comportamentais.			

Conteúdo Programático:

UNIDADE I - Princípios Básicos de Economia, Finanças e Estatística

- 1) Princípios de Economia
 - a) Conceitos de Economia
 - b) PIB, PIB Real e PIB Per Capita
 - c) Inflação
 - d) IPCA, IGP-M, IGP-DI e IGP-10
 - e) Política Cambial
 - f) Taxa de Câmbio
 - g) Selic Meta e Selic Over
 - h) Política Monetária
 - i) CDI e TR
 - j) COPOM
 - k) Política Fiscal
 - l) Balanço de Pagamentos
- 2) Princípios de Finanças
 - a) Juros e Taxa Livre de Risco
 - b) Benchmark e Ibovespa
 - c) Marcação a Mercado
 - d) Prazo Médio e Duration
 - e) Volatilidade e Rentabilidade
 - f) Mercado Primário
 - g) Mercado Secundário
 - h) Clearing House
 - i) Custo Ponderado de Capital
 - j) Alavancagem Financeira
- 3) Princípios de Estatística
 - a) Média, Moda e Mediana
 - b) Variância, Desvio Padrão e Coeficiente de Variação
 - c) Covariância
 - d) Correlação
 - e) Coeficiente de Determinação
 - f) Distribuição Normal

UNIDADE II – Sistema Financeiro Nacional

- 1) Funções Básicas
- 2) Estrutura do Sistema Financeiro Nacional
 - a) Subsistema Normativo
 - i) CMN
 - ii) BACEN e COPOM
 - iii) CVM
 - iv) PREVIC
 - v) SUSEP
 - b) Subsistema de Intermediação
 - i) Instituições Financeiras Bancárias
 - ii) Instituições Financeiras Não Bancárias
 - iii) Bancos Múltiplos
 - c) Instituições Auxiliares
 - i) BOVESPA
 - ii) BM&F
 - d) Outros Intermediários
 - i) SCTVM

- ii) SDTVM
- e) Sistema de Liquidação e Custódia
- i) CETIP
- ii) SELIC
- iii) Clearing House
- iv) SPB
- v) STR
- vi) LBTR
- f) Esquema resumido do SFN

UNIDADE III - Compliance Legal, Ética e Análise do Perfil do Investidor

- 1) Princípios Éticos
- 2) Códigos de Regulação e Melhores Práticas da ANBIMA
- 3) Prevenção contra a Lavagem de Dinheiro
- 4) Ética na Venda
- 5) Análise do Perfil do Investidor

UNIDADE IV - Princípios de Investimento: Conceitos

- 1) Principais Fatores de Análise de Investimentos
- 2) Principais Riscos do Investidor
- 3) Fatores determinantes para adequação dos produtos de investimentos as necessidades dos investidores

UNIDADE V – Produtos de Investimentos

- 1) Conceitos Introdutórios
- 2) Instrumento de Renda Fixa
 - a) Títulos Públicos
 - b) Caderneta de Poupança
 - c) CDB
 - d) Títulos de Crédito Imobiliário
 - e) Nota Promissória
 - f) Debêntures
- g) Operações Compromissadas
- 3) Instrumento de Renda Variável
 - a) O Mecanismo do Mercado
 - b) Ações
 - c) Juros sobre Capital Próprio
 - d) Clube de Investimentos

UNIDADE VI – Fundos de Investimento

- 1) Definições Legais
- 2) Dinâmica de Aplicação e Resgate
- 3) Principais características
- 4) Política de Investimento
- 5) Carteira de Investimentos
- 6) Taxas de Administração e Outras
- 7) Tipos de Fundos - Classificação CVM

UNIDADE VII – Tributação

- 1) Tributação

Metodologia:

A disciplina será ministrada por meio de jogos que serão construídos nas aulas e os alunos irão aprender através desses jogos de forma lúdica. Além disso, haverá leitura de textos complementares, resolução de exercícios para obtenção de dados para elaboração dos jogos e práticas didáticas que possibilitem a participação efetiva dos alunos no processo de apreensão e consolidação dos conteúdos programáticos.

Critérios / Processo de avaliação da aprendizagem:

Será avaliada a capacidade do aluno de resolver problemas relativos a finanças, utilizando os conceitos e ferramentas apresentados no curso. É essencial que os alunos explicitem qual a solução proposta e como chegaram a essa solução.

A avaliação será por meios de seminários e apresentação dos jogos em grupos.

Os alunos com média parcial igual ou superior a 7,0 estarão aprovados, com média final igual à média parcial. Os demais deverão fazer a prova final, envolvendo todo o conteúdo da disciplina

OBS.: (1) o aluno deve estar presente, no mínimo, em 75% das aulas. Vale ressaltar que os alunos que não comparecerem a, pelo menos, 75% das aulas serão reprovados por falta independentemente dos resultados obtidos em outros quesitos do processo de avaliação, ressalvados os casos previsto

Bibliografia Básica:

1. ASSAF NETO, Alexandre; LIMA, Fabiano Guasti. Curso de Administração Financeira. 4ª ed., Atlas, 2019.

2. BREALEY, Richard A.; MYERS, Steward C; ALLEN, Franklin. Princípios de finanças corporativas. 12ª Edição, McGraw Hill. 2018.

3. ROSS, Stephen A; Westerfield, Randolph W.; Jordan, Bradford D.; LAMB, Roberto. Administração Financeira. 10ª Edição, McGraw Hill. 2015.

Observações: todos esses livros estão disponíveis nas Bibliotecas Digitais da UFES

Bibliografia Complementar:

1. ASSAF NETO, Alexandre. Matemática Financeira – Edição Universitária. Atlas, 2017.

2. BRUNI, Adriano Leal. Introdução à Matemática Financeira. Atlas, 2019.

3. DAMODARAN, Aswath. Valuation. LTC, 2012.

4. PADOVEZE, Clóvis Luís. Introdução à Administração Financeira. 2ª ed., Cengage Learning, 2013.

5. VARIAN, Hal R. Microeconomia: uma abordagem moderna. Rio de Janeiro: Elsevier, 2015.

Observações: todos esses livros estão disponíveis nas Bibliotecas Digitais da UFES

Observações:**Cronograma:**

Aulas	Dias	Conteúdo
1	24/04	Apresentações professora/alunos/as e plano de ensino. Introdução à temática.
2	24/04	Unidade I 1.a, b, c, d, e, f, g, h, i, j, k, l - elaboração de questões para os jogos
3	08/05	Unidade I 2. a, b, c, d, e, f, g, h, i, j elaboração de questões para os jogos
4	08/05	Unidade I 3. a, b, c, d, e, f elaboração de questões para os jogos
5	15/05	Unidade I Fechamento das questões e realização dos jogos dessa parte do conteúdo ministrado

6	15/05	Unidade I Fechamento das questões e realização dos jogos dessa parte do conteúdo ministrado
7	22/05	Unidade II 2 a, b Elaboração do questões
8	22/05	Unidade II 2 c, d, e, f Elaboração do questões
9	29/05	Unidade II Semana de Administração *
10	29/05	Unidade II Semana de Administração *
11	05/06	Unidade III – 3 itens 1, 2, 3, 4, 5
12	05/06	Unidade III – Leitura dirigida e debate sobre o tema
13	12/06	Unidade III – Elaboração do jogo e troca de informações. Verificar as questões elaboradas e certificar que estão corretas, jogando
14	12/06	Unidade III – Elaboração do jogo e troca de informações jogando o jogo construído até o momento
15	26/06	Unidade III – Parada para acertos necessários e colocar os jogos no sistema. Avaliação
16	26/06	Unidade III – Parada para acertos necessários e colocar os jogos no sistema. Avaliação 1
17	03/07	Unidade IV – itens 1 e 2 - Explicação do conteúdo Elaboração de questões para o jogo
18	03/07	Unidade IV – item 3– Explicação e discussão sobre os assunto Elaboração de questões para o jogo e digitação no sistema
19	10/07	Unidade V itens 1 e 2 - explicação e filme/vídeo sobre o assunto
20	10/07	Unidade V – Elaboração de questões sobre o assunto
21	17/07	Unidade V Jogando o jogo elaborado até o momento
22	17/07	Unidade V Jogando o jogo elaborado até o momento
23	31/07	Unidade VI – Leitura dirigida sobre o tema. Explicação e esclarecimento de dúvidas
24	31/07	Unidade VI – Exercícios e esclarecimento de dúvidas
25	07/08	Unidade VII – Explicação sobre o tema
26	07/08	Unidade VII – Elaboração das dicas e questões sobre o tema
27	14/08	Finalização do jogo
28	14/08	Finalização do jogo
29	21/08	-Avaliação 2
30	21/08	- Avaliação 2
31	28/08	Prova Final