

Conteúdo Programático, Bibliografia (indicação opcional) e Sistematização da Prova Prática (quando houver)

Edital UFRJ nº 875, de 19 de setembro de 2025

Haverá Prova Prática: () Sim (x) Não

Unidade**Código da
Opção de Vaga**

MC - 009

**Departamento ou
Programa /
Setorização Definitiva**

COPPEAD / Programa de Pós-Graduação em Administração / Finanças

**Conteúdo
Programático**

PONTO 1 - Renda Fixa. Taxa, Duração, Convexidade e Imunização. Curvas de Juros. Título sem cupom. Debêntures. Modelos de Avaliação pela Flutuação da Estrutura de Termos. Análise de Risco de títulos pré-fixados

PONTO 2 - Derivativos. Swaps. Forwards. Futuros. Fluxos de pagamentos. Modelos de Avaliação. Análise de Risco;

PONTO 3 - Derivativos. Opções de Compra e de Venda sobre disponível. Fluxos de pagamentos. Modelos de Avaliação, Binomial e de Black & Scholes. Análise de Risco;

PONTO 4 - Avaliação de projetos e de empresas. Avaliação de empresas alavancadas (abordagem pelo WACC, pelo valor presente ajustado - APV e através do fluxo de caixa aos acionistas – FTE);

PONTO 5 - Estrutura de Capital, de Modigliani & Miller à Moderna Teoria de Estrutura de Capital (Financial Distress, Custos Legais etc);

PONTO 6 - Análise de Risco. Modelos para estimativas de volatilidades;

PONTO 7 - Eficiência de Mercados. Conceitos e Testes. Expectativas Racionais e Eficiência de Mercado. Eficiência e Modelos de Avaliação;

PONTO 8 - Risco, Retorno e Custo de Oportunidade de Capital. Equilíbrio de Mercado. Modelos CAPM e APT. Propriedades dos Modelos. Principais testes empíricos;

PONTO 9 - Modelo de Regressão Linear e suas análises;

PONTO 10 - Análise de Séries Temporais. Processos auto-regressivos e de médias móveis. Processos integrados e não estacionários. Modelos AR, MA e ARIMA. O enfoque de Box- Jenkins. Modelos de variância condicional heterocedástica (ARCH, GARCH).

**Bibliografia
(indicação opcional)**

- BOLTON, P. et al. The Green Swan: Central banking and financial stability in the age of climate change. Bank for International Settlements (BIS) e Banque de France, 2020
- BREALEY, R. A.; MYERS, S. C.; ALLEN, F. Principles of Corporate Finance. 12 ed. McGraw-hill, 2017.
- BUENO, R. L. S. Econometria de séries temporais. São Paulo: Cengage Learning, 2011
- ELTON, E. J. et al. Modern Portfolio Theory and Investment Analysis. 9 ed. Wiley 2014.
- HULL, J. C. Options, futures and other derivatives. 10 ed. Pearson, 2017.

	<ul style="list-style-type: none"> • MONTGOMERY, D. C.; PECK, E. A.; VINING, G. G.. Introduction to Linear Regression Analysis. 6. ed. Nova York: Wiley, 2021. • ROSS, S. A.; WESTERFIELD, R. W.; JAFFE, J. Corporate Finance. 10 ed. McGraw-hill, 2013.
Sistematização da Prova Prática	