



UNIVERSIDADE FEDERAL DE UBERLÂNDIA



FICHA DE COMPONENTE CURRICULAR

CÓDIGO:	COMPONENTE CURRICULAR: GESTÃO DE INVESTIMENTOS	
UNIDADE ACADÊMICA OFERTANTE: FACULDADE DE GESTÃO E NEGÓCIOS		SIGLA: FAGEN
CH TOTAL TEÓRICA: 60 horas	CH TOTAL PRÁTICA: -- horas	CH TOTAL: 60 horas

1. **OBJETIVOS**

A disciplina tem como objetivo principal fornecer ao aluno conhecimentos referentes à gestão de recursos em renda fixa e renda variável aplicada ao âmbito de fundos de investimento.

2. **EMENTA**

Investindo no Mercado de Renda Fixa no Brasil: Fundos, CDB, Letras de Crédito, Debêntures e Títulos Públicos; Mercado de Renda Variável: Ações, Aluguel de Ações, Fundos de Ações, Fundos Multimercado e Fundos de Índice; Medidas de avaliação de performance e risco; Estratégias de proteção com derivativos (futuros, opções e COE).

3. **PROGRAMA****1 - Mercado de Renda Fixa**

- 1.1 Função das Agências de Rating e suas classificações.
- 1.2 Fundo Garantidor de Crédito
- 1.3 Detalhamento dos Títulos Bancários (CDB, LCA, LCI) e Privados (CRI, CRA, LF, Debêntures)
- 1.4 Detalhamento e Precificação de Títulos Públicos (Tesouro Direto)
- 1.5 Detalhamento dos Fundos de Renda Fixa e Fundos Imobiliários
- 1.6 Tributação dos Títulos de Renda Fixa

2 - Mercado de Renda Variável

- 2.1 Detalhamento dos Fundos de Renda Variável, categorias e riscos.
- 2.2 Gestão Ativa x Gestão Passiva de Fundos x Hipótese de Mercados Eficientes
- 2.3 Análise detalhada da Lâmina dos Fundos de Investimentos.

2.4 Detalhamento dos COEs (Certificados de Operações Estruturadas)

2.5 Detalhamento das Negociações de Ações

2.6 Aluguel de Ações

2.7 Tributação dos Títulos de Renda Variável

3- Otimização de Carteiras

3.1 Composição

3.2 Aspectos Operacionais

3.3 Otimização da Composição do Mix de Carteira

3.4 Desempenho: Apresentação de medida de Sharpe, Jensen, Treynor, Sortino e Market Timing

4 - Derivativos

4.1 Introdução: Conceitos; Participantes; Tipos de derivativos

4.2 - Opções

4.3 - Contrato Futuro

4. BIBLIOGRAFIA BÁSICA

COVA, C. J. G. **Finanças e mercados de capitais: mercados fractais – a nova fronteira das finanças**. São Paulo: Cengage Learning, 2012.

LAGIOIA, U. C. T. **Fundamentos do mercado de capitais**. 3. ed. São Paulo: Atlas, 2011.

PINHEIRO, J. L. **Mercado de capitais: fundamentos e técnicas**. 6. ed. São Paulo: Atlas, 2012.

5. BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

CAVALCANTE, F.; MISUMI, J. Y.; RUDGE, L. F. **Mercado de capitais: o que é, como funciona**. 7. ed. Rio de Janeiro: Elsevier, 2009.

DUARTE JUNIOR, A. M. **Gestão de riscos para fundos de investimentos**. São Paulo: Prentice Hall, 2005.

ELTON, E. J. **Moderna teoria de carteiras e análise de investimentos**. São Paulo: Elsevier, 2012.

LIMA, I. S.; LIMA, G. A. S. F.; PIMENTEL, R. C. **Curso de mercado financeiro: tópicos especiais**. São Paulo: Atlas, 2006.

MENESES, A.; MARIANO, F. **Mercado financeiro: teoria, questões comentadas e mais de 100 questões propostas**. Rio de Janeiro: Elsevier, 2011.

PIMENTA, T.; LIMA, F. G. **Aprenda a usar análise técnica para investir em ações**. Ribeirão Preto: Inside Books, 2010.

6. APROVAÇÃO

Prof. Dr. Eduardo Giarola
Coordenador do Curso de Graduação em Administração

Profa. Dra. Kárem Cristina de Sousa Ribeiro
Diretora da Faculdade de Gestão e Negócios



Documento assinado eletronicamente por **Eduardo Giarola, Presidente**, em 14/10/2020, às 09:26, conforme horário oficial de Brasília, com fundamento no art. 6º, § 1º, do [Decreto nº 8.539, de 8 de outubro de 2015](#).



Documento assinado eletronicamente por **Kárem Cristina de Sousa Ribeiro, Diretor(a)**, em 15/10/2020, às 14:06, conforme horário oficial de Brasília, com fundamento no art. 6º, § 1º, do [Decreto nº 8.539, de 8 de outubro de 2015](#).



A autenticidade deste documento pode ser conferida no site https://www.sei.ufu.br/sei/controlador_externo.php?acao=documento_conferir&id_orgao_acesso_externo=0, informando o código verificador **2319562** e o código CRC **9E6058DC**.

Referência: Processo nº 23117.061000/2020-26

SEI nº 2319562