

Súmula das Disciplinas

Curso de Formação em Mercado de Capitais 2016

Economia & Mercado de Capitais

Aspectos recentes da política econômica brasileira, análise do cenário macro, discussão de variáveis macroeconômicas

Análise de Balanços

Estrutura das demonstrações contábeis

Demonstrações contábeis em moedas fortes

Informações contábeis para CVM

Notas explicativas e Pareceres dos Conselhos de Administração, Fiscal e Auditorias

Análise das demonstrações financeiras e projeções de resultados

Análise do fluxo de caixa

Análise do capital de giro com cálculos de ciclos financeiros e operacionais

Métodos de análise de investimentos – ênfase em casos práticos

Valuation

Análise dos objetivos da empresa e demonstrações financeiras

Geração de caixa

Indicadores econômicos financeiros (liquidez, endividamento, rentabilidade, giro e índices de mercado)

Análise de casos práticos

Avaliação de ativos sob condição de certeza e risco

Risco e taxa de juros

Cases de avaliação de empresas

Análise Técnica

Teoria de Dow

Gráficos de barra

Formações de estratégias operacionais

As ondas de Elliot

Gestão de Risco e Administração de Carteiras

Instrumentos de controle e gerenciamento de risco

Conceituação e metodologia de determinação

A abordagem de Markowitz

Determinação da fronteira eficiente

Seleção do portfolio ótimo

O modelo de Sharpe

Utilização de Betas

Medidas do desempenho ajustadas ao risco

Diversificação internacional de carteiras

Renda Fixa

Formação das Taxas de Juros: prefixadas e pós-fixadas

Títulos públicos de Renda Fixa: Títulos Pré - LTN; Títulos Pós - LFT; Títulos Indexados - NTN-C e NTN-D

Títulos Privados de Renda Fixa: CDB, RDB, CDI, Debêntures e Notas Promissórias

Fundos de Investimento (FIFs e FACs)

Simulação de Operações nos Mercados Primário e Secundário

Derivativos-Precificação

Fundamentos de avaliação de derivativos

Precificação de Futuros

Precificação de opções

Modelo de Black & Scholes

Modelo binomial

Estratégia de Derivativos

Participantes(características)

Segurança das operações(principais diferenças entre os mercados)

Utilizando os instrumentos de hedge.

Estratégias mais comuns

Seminário Mercados de Capitais I e II

A história do dinheiro

O dinheiro supranacional

Moedas e Câmbio & Juros e Inflação

Dívida X Investimento

Fluxo de Capitais – acompanhamento

As agências de avaliação de risco no mundo

Investimentos no Brasil e no exterior

Captação de recursos no Brasil e no exterior

Fusão das Bolsas

Panorama atual do Mercado de Capitais

Noções Jurídicas

Discussão de normativas e regras do Sistema Financeiro Nacional

Tributação

Discussão de normativas e regras da Receita Federal do Brasil no Mercado de Capitais