

**FACULDADE DE ECONOMIA, ADMINISTRAÇÃO, CONTABILIDADE E ATUÁRIA  
PROGRAMA DE ENSINO**

**Curso: Economia**

**Ano: 2024**

**Disciplina: ECONOMIA APLICADA AO MERCADO FINANCEIRO BRASILEIRO**

**Código:**

**Créditos: 02**

**Carga Horária: 34 Horas-Aula**

**Professor Doutor Marcelo RANIERI. ([mranielcardoso@gmail.com](mailto:mranielcardoso@gmail.com))**

**OBJETIVOS GERAIS**

Discutir os conceitos econômicos e financeiros relacionados ao contexto do Mercado Financeiro Brasileiro, as flutuações da Economia Brasileira, intervenções do Governo ou Órgãos Reguladores construindo ao longo do curso uma base de conhecimento do Mercado Financeiro Brasileiro com seus players, produtos e serviços, e avaliando as interações da Economia com o Mercado Financeiro, e vice-versa. Resolver e discutir exercícios que são cobrados nas provas de certificações, tais como, CPA-20 e CEA.

**OBJETIVOS ESPECÍFICOS**

Construção de todos os conceitos necessários para o entendimento do Mercado Financeiro Brasileiro dentro do contexto do Sistema Financeiro Nacional e relações destes com a Economia Brasileira, bem como das definições acerca de produtos financeiros e conceitos econômico-financeiros dos exames de certificações.

**CONTEÚDO PROGRAMÁTICO**

**1. Introdução**

- 1.1. Principais conceitos do Sistema Financeiro
- 1.2. Órgãos e regulação do Sistema Financeiro Nacional
- 1.3. Mercados do Sistema Financeiro

**2. Mercado Monetário e de Capitais**

- 2.1. Estrutura
- 2.2. Produtos
- 2.3. Relação com a Economia

**3. Mercado de Crédito e Cambial**

- 3.1. Estrutura
- 3.2. Produtos
- 3.3. Relação com a Economia

**4. Risco de Mercados**

- 4.1. Definição das medidas de Risco de Mercado
- 4.2. Demais definições de Risco (de Moeda, de Liquidez, de Taxa de Juros, de Crédito, Operacional, Legal)

**5. Teoria de Carteiras**

- 5.1. Análise de Risco e Retorno
- 5.2. Diversificação de ativos

**6. Captação de Recursos no Exterior**

- 6.1. ADR e BDR
- 6.2. Bonds e Eurobonds

**7. Fundos de Investimento**

- 7.1. Estrutura regulatória
- 7.2. Principais definições
- 7.3. Análise de Risco e Retorno

**8. Avaliação Prática dos principais produtos financeiros**

- 8.1. Produtos Financeiros para Captação de Recurso
- 8.2. Produtos Financeiros para Investimentos de Recursos

## BIBLIOGRAFIA BÁSICA

1. ASSAF NETO, Alexandre. **MERCADO FINANCEIRO**. 9a. ed. São Paulo: Atlas, 2009.
2. ASSAF NETO, Alexandre. **MERCADO FINANCEIRO: Exercícios e Prática**. 2a. ed. São Paulo: GEN-Atlas, 2019.
3. GALVÃO, Alexandre [et al.]. **MERCADO FINANCEIRO: UMA ABORDAGEM PRÁTICA DOS PRINCIPAIS PRODUTOS E SERVIÇOS**. Rio de Janeiro: Elsevier, 2006.
4. LIMA, LIMA E PIMENTEL. **CURSO DE MERCADO FINANCEIRO**. 2ª ed., São Paulo, Editora Atlas, 2012.
5. FORTUNA, Eduardo. **MERCADO FINANCEIRO: PRODUTOS E SERVIÇOS**. 18. ed. Rio de Janeiro: Qualitymark, 2010.
6. **Eventuais PAPERS.**
7. **Sites do Banco Central, CVM, Susep, Tesouro Direto, CETIP e demais órgãos e instituições.**

## METODOLOGIA

- O CURSO SE COMPÕE DE AULAS EXPOSITIVAS.
- APRESENTAÇÃO E DISCUSSÃO DA TEORIA.
- DISCUSSÃO DE CASOS PRÁTICOS.
- A PARTICIPAÇÃO ATIVA DOS ALUNOS É IMPRESCINDÍVEL E SERÁ AVALIADA POR MEIO DE PEQUENAS ESTUDO DE CASOS E DEBATE EM AULA.
- NOTAS:
  - PROVA – 30%
  - APRESENTAÇÃO E ENTREGA DE TRABALHO ESCRITO (GRUPO) – 30%
  - TESTES (MOODLE OU TEAMS) – 40%