

Formação de analista do Mercado Financeiro

1. Objetivo

Preparar profissionais de para atuar no sofisticado mercado financeiro brasileiro, nas áreas do mercado financeiro e do mercado de capital e cambial. Ao final do curso, os profissionais estarão aptos a participar de processos de certificação do mercado financeiro, bem como a ocuparem cargos de relevância em organizações empresariais, onde o conhecimento deste mercado seja fundamental para um desempenho profissional.

2. Disciplinas

Economia e Cenários

- Elementos de Economia;
- Políticas Macroeconômicas;
- Futuros e Cenários: introdução;
- Futuros e Cenários: prospectiva e incerteza;
- Planejamento e Cenários;
- Metodologia geral de construção de cenários;
- Técnicas de construção de cenários: elementos
- Técnicas de construção de cenários: estudo de casos.

Análise das Demonstrações Financeiras

- Estrutura das Demonstrações Financeiras: CPC 26;
- Análise por intermédio de indicadores: liquidez, estrutura – visão dos credores;
- Análise por intermédio de indicadores: rentabilidade;
- Indicadores econômicos (Lucro Econômico, EVA, MVA): visão de avaliação econômica e de gestão do valor;
- Análise da situação econômico-financeira (Relatório da Administração e Formulário de Referência): visão do investidor;
- Estrutura da Demonstração dos Fluxos de Caixa: CPC 3;
- Análise do caixa gerado pelas operações: visão dos acionistas e dos gestores;
- Indicadores de Análise de Instituições Financeiras.

Matemática Financeira

- Revisão do uso de máquinas financeiras - HP 12 C - Conceito de Juros - Desconto de Duplicatas;
- Juros Compostos - Equivalência Juros Compostos x Juros Simples x Desconto de Duplicatas;
- Juros Compostos - Valores em Datas Diferentes;
- Juros Compostos - Equivalência de Taxas;
- Sistemas de Amortização-Sistema Price e Sistema de Amortização Constante-SAC;
- Sistema de Amortização Price - Postecipado e Antecipado;
- Sistema de Amortização Price x Sistema SAC;
- Juros Reais, Juros Nominais e Taxa de Inflação.

Tributação aplicada ao Mercado Financeiro

- Introdução aos aspectos tributários;
- Impostos Diretos: IRPJ e CSLL;
- Impostos Indiretos: PIS ,COFINS , IOF e ISS;
- Instrumentos Financeiros: Contabilização e Tributação;
- Obrigações acessórias aplicáveis a tributos diretos e indiretos;
- Noções de planejamento tributário aplicado a instituições financeiras.

Estatística Aplicada á Finanças

- Probabilidade;
- Variáveis aleatórias / distribuições e medidas;
- Estimção por intervalos de confiança;
- Testes de hipóteses - um parâmetro;
- Testes de hipóteses - vários parâmetros;
- Análise de variância;
- Covariância e regressão;
- Regressão linear.

Derivativos

- Funcionamento da BM&F Bovespa;
- Conceitos básicos do mercado de derivativos;
- Operações de Swap;
- Mercados futuros e a termo;
- Estratégias com contratos futuros;
- Mercado de Opções;
- Estratégias com Opções;
- O uso de derivativos na gestão de riscos.

Sistema Financeiro Nacional – Estrutura e aspectos relevantes

- Funções básicas e estrutura;
- Órgãos de regulação, auto regulação e fiscalização;
- Principais intermediários financeiros;
- Órgãos auxiliares;
- Ética, regulamentação e análise do perfil do investidor;
- Prevenção contra a lavagem de dinheiro;
- Certificações;
- Evolução recente e perspectivas.

Investimentos no Mercado de Capitais

- Evolução recente do mercado de capitais no Brasil;
- Governança Corporativa e o mercado de capitais;
- Produtos do mercado de capitais: Debêntures e Ações.
- Abertura de Capital;
- Novo Mercado;
- Aspectos da análise fundamentalista de ações;
- Aspectos relevantes na indicação de investimentos.

Gestão de Carteiras de Investimentos

- Introdução à gestão de carteiras de investimentos;
- Medidas de risco;
- Medidas de risco aplicadas a carteiras;
- Relação entre riscos e retorno no mercado de capitais;
- CAPM – 1;
- CAPM – 2;
- Avaliação do risco da carteira.

Mensuração, Gestão de Performance e Risco

- Risco, retorno e diversificação;
- Acordos da Basileia e gestão de riscos;
- Riscos estratégicos;
- Riscos Operacionais;
- Riscos Financeiros;
- Riscos de crédito – de instituições;
- Riscos de crédito – de pessoa jurídica;
- Riscos de crédito – pessoas físicas.

Governança Corporativa

- Origens e modelos de governança corporativa;
- Governança nas empresas familiares;
- Conselho de Administração: legislação;
- Conselho de Administração: boas práticas de governança corporativa;
- Conselho fiscal e comitê de auditoria
- Auditoria independente e auditoria interna;
- O Novo Mercado;
- Transparência: modelo de referência e notas explicativas.

Fundos e Outros Produtos de Investimentos

- Fundos de investimentos – aspectos gerais;
- Estratégias de gestão de fundos;
- Principais modalidades;
- Código ANDIMA de Regulação – Melhores Práticas;
- Instrumentos de renda variável;
- Instrumentos de renda fixa;
- Oferta pública de valores mobiliários;
- Compliance e Código de Conduta no Mercado Financeiro.

Câmbio e Finanças Internacionais

- Ambiente monetário internacional;
- Mercado de câmbio e determinação da taxa de câmbio;
- Relação entre taxas de câmbio, inflação e taxas de juros;
- Operações de arbitragem no mercado internacional (carry trade);
- Administração da exposição e transações através de derivativos cambiais;
- Gestão das exposições econômicas e conversão;
- Financiamento do comércio internacional;
- Análise da gestão do caixa internacional.

Contabilidade e Métodos Quantitativos

- Fundamentos de Contabilidade;
- Estatística básica;
- Fundamentos de Matemática.

(dispensado se aprovado no exame de suficiência)

3. Informações Gerais

Campus Largo São Francisco – Largo São Francisco, 19

Dia da semana: Segundas e Quartas

Horário: das 19h às 22h30

Duração: 01 ano e meio

Carga Horária: 378 horas/aula

Campus Pinheiros – Rua Arthur de Azevedo, 1637

Dia da semana: Terças e Quintas

Horário: das 19h às 22h30

Duração: 01 ano e meio

Carga Horária: 378 horas/aula