



Universidade Presbiteriana

Mackenzie

CCSA - Centro de Ciências Sociais e Aplicadas

Programa de Pós-Graduação em Administração de Empresas

PLANO DE ENSINO

Programa de Pós-Graduação: Administração de Empresas		
Curso: ☒ Mestrado Acadêmico ☐ Mestrado Profissional ☒ Doutorado		
Disciplina: Investimentos		Código: ENST54932
Professor: Wilson Toshiro Nakamura		DRT: 1098291
Carga horária: 32 Horas	Créditos: 2	☐ Obrigatória ☒ Optativa
Ementa: Discutir os principais tópicos de investimentos, envolvendo carteira de ações, carteira de renda fixa, o uso de derivativos no campo de investimentos e os principais modelos para fins de seleção de títulos e alocação de ativos.		
Objetivos: Consolidar conhecimentos relacionados a investimentos, envolvendo conhecimento teórico, aplicação prática e evidências empíricas.		
Conteúdo Programático: Introdução a investimentos. Teoria e prática de carteiras. Capital asset pricing model. Arbitrage pricing theory e modelos multifatoriais de risco e retorno. Títulos de renda fixa. Análise de títulos. Opções, futuros e outros derivativos. Administração de carteira aplicada.		
Metodologia: Aulas expositivas, porém, supondo a leitura prévia dos capítulos de livro programados para cada aula, bem como de alguns artigos científicos, conforme indicação do professor da disciplina. Eventualmente, durante as aulas ou fora das aulas, o professor solicitará que os alunos resolvam problemas práticos ou discutam casos selecionados.		
Critério de Avaliação: Participação nas aulas – 40% Prova final – 40% Pré-projeto de artigo sobre tema relacionado à disciplina – 20%		

Bibliografia (livros):

BERK, Jonathan e DEMARZO, Peter. *Corporate Finance* Fifth Edition. Pearson, 2019.

BODIE, Zvi, KANE, Alex e MARCUS, Alan J.. *Investments*. Twelfth Edition. McGraw Hill. 2021.

BREALEY, Richard A., MYERS, Stewart C. e ALLEN, Franklin. *Principles of Corporate Finance*. 13a. Edition. McGraw-Hill, 2019.



COPELAND, Thomas E., WESTON, J. Fred e SHASTRI, Kuldeep. *Financial theory and corporate policy*. 4th Edition. Pearson Addison-Wesley, 2005.

DAMODARAN, Aswath. *Corporate finance*. 2nd Edition. Wiley Series in Finance, 2001.

ELTON, Edwin J., GRUBER, Martin J., BROWN, Stephen J. e GOETZMANN, William N.. *Moderna Teoria de Carteiras e Análise de Investimentos*. Campus. 2012.

GRINBLATT, Mark e TITMAN, Sheridan. *Mercados Financeiros & Estratégia Corporativa*. 2a. Edição. Bookman, 2005.

JENSEN, Geraldo R. e JONES, Charles P.. *Investments – Analysis and Management*. Fourteenth Edition. Wiley. 2020.

LINTON, David E.. *Foudations of Investment Management*. J. Ross Publishing. 2020.

LUENBERGER, David G.. *Investment Science*. Second Edition. Oxford University Press. 2013.

RAPPAPORT, Alfred e MAUBOUSSIN, Michael J.. *Análise de Investimentos*. Campus. 2001.

VISHWANATH, S. R. e KRISHNAMURTI, Chandrasekhar. *Investment Management: A Modern Guide to Security Analysis and Stock Selection*. Springer. 2009.