

MINISTÉRIO DA EDUCAÇÃO

SECRETARIA DA EDUCAÇÃO SUPERIOR

**CENTRO FEDERAL DE EDUCAÇÃO TECNOLÓGICA
CELSO SUCKOW DA FONSECA**

CURSO DE ENGENHARIA DE PRODUÇÃO

DEPARTAMENTO		PLANO DE CURSO DA DISCIPLINA			
DEPRO		ANÁLISE DE INVESTIMENTO			
CÓDIGO	PERÍODO	ANO	SEMESTRE	PRÉ-REQUISITOS	
GPRO 7829		2007	2		
CRÉDITOS	AULAS/SEMANA			SEM PRÉ REQUISITO	
3	TEÓRICA	PRÁTICA	ESTÁGIO		
	3	0	0	54	

EMENTA

Conceitos básicos de opções. Modelos de avaliação de opções. Avaliação de opções reais.

BIBLIOGRAFIA

1. Damodaran, A. – Avaliação de Investimentos – Qualitymark Editora, 2000.
2. Damodaran, A. - A face oculta da avaliação – Makron Books, 2000.
3. Silva, L.M. – Mercado de opções – BM&F, 2000.

OBJETIVOS GERAIS

Abordar os critérios de seleção de investimento em termos de opções reais.

METODOLOGIA

- Aulas expositivas com recursos audiovisuais;
- Apresentação de exemplos;
- Elaboração de exercícios práticos.

CRITÉRIO DE AVALIAÇÃO

- Provas escritas;
- Elaboração e apresentação de trabalhos.

CHEFE DO DEPARTAMENTO

NOME	ASSINATURA
Marina Brochado	

PROFESSOR RESPONSÁVEL PELA DISCIPLINA	
NOME	ASSINATURA

APROVADO PELO CONSELHO DEPARTAMENTAL EM: ____/____/____

PROGRAMA

- 1. Conceitos básicos da teoria de opções.**
- 2. Modelos de avaliação de opções**
 - Modelo binomial**
 - Modelo Black & Scholes**
- 3. Avaliação de opções reais: Projetos de Investimento**