



UNIVERSIDADE FEDERAL FLUMINENSE

PRÓ-REITORIA DE GRADUAÇÃO

DEPARTAMENTO DE ECONOMIA

Edital No. 01-M0007/2024

1.DA IDENTIFICAÇÃO

1.1 UNIDADE: Faculdade de Economia (ESC)

1.2 Departamento de Economia (SEN)

1.3 Título do Projeto: Monitoria em Derivativos e Renda Fixa

1.4 Código do Projeto: SENA0007

1.5 Disciplinas Vinculadas ao Projeto: SEN00182 - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA, SEN00190 - DERIVATIVOS

1.6 Professores Orientadores Vinculados ao Projeto: ANDRE BARBOSA OLIVEIRA

1.8 Este projeto visa alunos que ingressaram por Ampla Concorrência.

1.9 Número de vagas para alunos ingressantes por Ações Afirmativas: 0 bolsista(s).

1.10 Número de vagas por Ampla Concorrência: 1 bolsista.

2. DAS INSCRIÇÕES:

2.1 Período de 02/04/2024 à 08/04/2024.

2.2 Endereço Eletrônico da página disponibilizada para a Inscrição:
<https://app.uff.br/monitoria/>

2.3 Pré-Requisitos Fixados pelo Projeto de Monitoria (se houver):

ter cursado com aprovação as disciplinas SEN00182 - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA e SEN00190 - DERIVATIVOS.

2.4 Caso um (a) estudante ingressante por ampla concorrência se inscreva em processo seletivo exclusivo para ações afirmativas, não deverá ser autorizado (a) a realizar a prova e deverá ser excluído (a) do processo.

2.5 Estudantes que ingressaram por ação afirmativa podem se inscrever em processo seletivo com vaga para ampla concorrência, porém não ensejará a aplicação de bonificação ou de reserva.

3. DOS DOCUMENTOS EXIGIDOS DO ALUNO PARA A EFETIVAÇÃO DA INSCRIÇÃO.

3.1 Documentação comprobatória dos pré-requisitos fixados pelo Projeto de Monitoria consistem em:

histórico escolar.

3.2 Os documentos comprobatórios que conduzem a bônus sejam candidatos ingressantes por Ação Afirmativa ou Mães com filhos de até 5 (cinco) anos, conforme os artigos 12 e 13 da Instrução Normativa PROGRAD/UFF No.45 de 13 de dezembro de 2023 são, respectivamente, declaração de Ação Afirmativa de ingresso na Universidade e certidão de nascimento do(s) filho(s), para o bônus previsto no inciso II do art. 12 da Instrução Normativa PROGRAD/UFF No.35 de 20 de dezembro de 2022.

3.3. A documentação comprobatória para aplicação do(s) bônus de Ingresso por Ações Afirmativas ou Mães com filhos de até 5 (cinco) anos, deve ser enviada ao Coordenador de Monitoria, **durante o período de inscrições**, pelo enlace eletrônico:

aboliveira@id.uff.br

e com cópia para o e-mail jesus_alexei@id.uff.br, com assunto: “Documentação Bonus Monitoria Projeto código SENA0007”.

4. DA SELEÇÃO.

O processo seletivo é composto por duas fases: eliminatória e classificatória. A primeira consiste numa avaliação teórica de conteúdos relativa à ementa prevista no Edital, executada de forma presencial. Por sua vez, a segunda fase será regida por uma entrevista realizada de forma presencial ou online síncrona (sempre que houver entrevista online síncrona, a mesma deverá ser gravada para fins de avaliação de recursos).

4.1 DATA E HORÁRIO: 09/04/2024 às 16:00:00

4.2 LOCAL DE REALIZAÇÃO (e/ou link onde será executada a etapa da seleção)

Faculdade de Economia, Bloco F. Gragoatá. Sala

laboratório F206 da Faculdade de Economia da UFF, bloco F do campus do Gragoatá.

4.3 EMENTA E BIBLIOGRAFIA RELATIVA AO PROJETO OBJETO DO CONCURSO:

Ementa: Monitoria em Derivativos e Renda Fixa

Principais títulos privados (CDB, CDI, RDB, Debêntures, Notas Promissórias, etc.).
Principais Títulos Públicos. Letras do Tesouro Nacional (LTN); Letras Financeiras do Tesouro (LFT); Notas do Tesouro Nacional (NTN – Série B, Série C, Série F).
Precificação dos Títulos de Renda Fixa. Precificação de títulos prefixados e pós fixados.
Estrutura Temporal da Taxa de Juros. Taxa de juros a vista (spot) e a termo (forward).
Estimação da Estrutura Temporal da Taxa de Juros e Métodos de Interpolação. Interpolação aritmética (linear) e interpolação geométrica (flat forward). Splines. Bootstrap.
Derivativos de Taxa de Juros. Futuro de DI e Swaps.
Risco dos Títulos de Renda Fixa. Fatores de risco dos ativos de renda fixa. Duração e Convexidade.

Contratos a Termo. Retorno de posição comprada e vendida, preço de entrega. Risco de crédito de contraparte.

Contratos Futuros. Ajuste diário. Sistema de Margem.

Precificação de contratos a termo e futuros. Ativo com e sem dividendo, rendimento de conveniência, custo de estocagem, índice de bolsa e moedas externa.

Hedge. Ótimo, ingênuo e perfeito.

Opções. Estratégias, hedge e precificação.

SANTOS, J. C. DE. S.; SILVA, M. E. Derivativos e Renda Fixa: Teoria e Aplicações ao Mercado Brasileiro. ATLAS, 2015.

SECURATO, J. R. Cálculo Financeiro das Tesourarias: Bancos e Empresas. SAINT PAUL, 2015.

HULL, C. J. Opções, Futuros e Outros Derivativos. BOOKMAN, 2016.

4.4 CRITÉRIOS DE SELEÇÃO:

4.4.1 A banca examinadora avaliará os candidatos inscritos, atribuindo-lhes uma nota média final entre 0,00 (zero) e 10,0 (dez), respeitando o limite de duas casas decimais, a partir das notas atribuídas por cada membro da Banca de Seleção segundo o procedimento:

Média simples entre as fases eliminatórias e classificatória

4.4.2 Deverão ser adicionados às notas obtidas nos processos seletivos bônus para mães com filhos (as) de até 5 (cinco) anos, conforme critério descrito a seguir:

I - Se a nota média das etapas do processo seletivo for igual ou superior a 7 (sete), as candidatas que estiverem na condição de mães com filhos (as) com idade até 5 (cinco) anos

de idade terão esta média multiplicada por 1,2 (um vírgula dois), resultando na nota final a ser inserida no sistema.

II - Quando todas as candidatas forem beneficiárias do bônus previsto no caput, não há necessidade de aplicá-lo.

4.4.3 A nota mínima para aprovação é 7,00 (sete). A nota final máxima é 10,0 (dez).

4.5 CRITÉRIOS DE DESEMPATE (COM PONTUAÇÃO):

CR 4 pontos

4.6 DATA DE DIVULGAÇÃO DOS RESULTADOS: 11/04/2024

4.7 LOCAL DE DIVULGAÇÃO DOS RESULTADOS:

Faculdade de Economia, Bloco F. Gragoatá. Sala

Faculdade de Economia da UFF, bloco F do campus do Gragoatá.

4.7 INSTÂNCIAS DE RECURSO:

4.7.1- O prazo para a interposição de recurso ao resultado do processo seletivo junto ao Coordenador de Monitoria é de até 48 (quarenta e oito) horas após a divulgação dos resultados, contadas automaticamente pelo Sistema de Monitoria.

4.7.2- O recurso dirigido ao Coordenador de Monitoria deve ser enviado por e-mail a: jesus_alexei@id.uff.br, com assunto: "Recurso Monitoria Projeto SENA0007".

4.7.3- O prazo para a interposição de recurso junto à Comissão de Monitoria é de até 72 (setenta e duas) horas após a ciência do resultado da análise do recurso interposto junto ao Coordenador de Monitoria responsável pelo projeto.

4.7.4- O recurso dirigido à Comissão de Monitoria deve ser enviado por e-mail à Divisão de Monitoria (dmo.prograd@id.uff.br).

5. DA ACEITAÇÃO DA VAGA.

O candidato classificado no processo seletivo terá o prazo de 3 dias corridos, após a liberação do resultado do processo seletivo, para aceitar a vaga no Sistema de Monitoria. Será considerado desistente o candidato que não cumprir o prazo estabelecido.

6. DA ASSINATURA DO TERMO DE COMPROMISSO.

Os candidatos classificados deverão encaminhar ao endereço eletrônico da Secretaria que atende o Departamento/Coordenação de Curso o Termo de Compromisso, devidamente

assinado, gerado pelo Sistema de Monitoria, ou a declaração de que aceita as cláusulas do Termo de Compromisso no prazo de 5 (cinco) dias após o aceite no Sistema de Monitoria.

Niterói, 02/04/2024.

Victor Leonardo Figueiredo Carvalho de Araujo

Chefe do Departamento