

Analytical Corporate Valuation

Fundamental Analysis, Asset Pricing and
Company Valuation

PASQUALE DE LUCA

15 de agosto de 2021

Conteúdo

I	Análise Fundamentalista da Companhia	1
1	Análise do modelo de negócio da companhia	3
2	Análise de lucratividade da companhia	5
3	Análise da lucratividade do produto	7
II	Risco e Retorno no Mercado de Capital	9
4	Abordagem da função de utilidade	11
5	Abordagem da Média-Variância	13
6	Capital Asset Pricing Model - CAPM	15
III	Valuation da Companhia	17
7	Estrutura e custo de capital	19
8	Avaliação do patrimônio	21
9	Avaliação do empreendimento	23
10	Avaliação da dívida	25

Parte I

Análise Fundamentalista da Companhia

1

Análise do modelo de negócio da companhia

2

Análise de lucratividade da companhia

3

Análise da lucratividade do produto

Parte II

Risco e Retorno no Mercado de Capital

4

Abordagem da função de utilidade

5

Abordagem da Média-Variância

6

Capital Asset Pricing Model - CAPM

Parte III

Valuation da Companhia

7

Estrutura e custo de capital

8

Avaliação do patrimônio

9

Avaliação do empreendimento

10

Avaliação da dívida