

Investimentos

Introdução; Introdução aos Mercados e Instrumentos Financeiros; Mercado Financeiro; Matemática Financeira: uma breve recordação; Princípios e Aplicações de Cálculo Financeiro; Matemática Financeira Objetiva; Teoria de Carteira; Escolha envolvendo risco; Alocação de ativos: análise de dois períodos e fronteira média-variância; Alocação de ativos: análise de longo prazo; Equilíbrio no Mercado de Capitais; O CAPM; Modelos de fatores e APT; Eficiência de Mercado: conceitos e evidência; Apreçamento Arrow-Debreu e opções. Títulos de renda fixa; Preços e rendimentos dos bônus; Estrutura a termo da taxa de juros e seus derivativos; Gerenciamento de carteiras de renda fixa; Avaliação de Ações; Derivativos; Introdução aos Mercados de Derivativos; Avaliação de Contratos a Termo, Futuros e Swaps; Avaliação de Opções; Derivativos de Juros; Gerenciamento Ativo de Carteiras; Avaliação de Performance; Diversificação Internacional; O Processo de Gerenciamento de Carteira; Teoria do Gerenciamento Ativo de Carteira.

INFORMAÇÕES BÁSICAS

☐ Carga horária: 60

☐ Pré-requisitos: Estatística

BIBLIOGRAFIA

Obrigatória:

- ☐ DANTHINE e DONALDSON. Intermediate Financial Theory. Prentice Hall (DD)
- ☐ LENGWILER, Y. Microfoundations of Financial Economics. Princeton Series in Finance. (L1)
- ☐ LUENBERGER, D. Investment Science. Oxford University Press. (L2)