
ECO 1122 Economia Financeira 2

CARGA HORÁRIA TOTAL: 60hs

CRÉDITOS: 4

PRÉ-REQUISITO(S): eco1721 ou eng1501 ou ind1115

Professora Maria de Nazareth Maciel

OBJETIVOS

O CURSO APRESENTA OS PRINCIPAIS CONCEITOS DOS MERCADOS DE DERIVATIVOS (FUTURO, TERMO, SWAP E OPÇÕES) E DESENVOLVE TÉCNICAS DE APREÇAMENTO BASEADAS EM CONDIÇÕES DE AUSÊNCIA DE ARBITRAGEM.

EMENTA

Mercado de derivativos do Brasil e no exterior.

Derivativos financeiros: Contratos Futuros, Contratos a Termo, Swaps e Opções

PROGRAMA

O Mercado financeiro

Introdução aos mercados de derivativo: conceito, tipos e funções.

Mercados a termo e futuro: hedge, estratégia e precificação.

Taxas de juros e duração.

Mercado de swap, CDS e securitização.

Futuro DI, Futuro de Cupom Cambial (DDI), FRA.

Mercado de opções

Estratégias de investimentos envolvendo derivativos

Introdução às árvores binomiais

Modelagem de preços de ações com o modelo de Black-Scholes e binomial.

Estudo de volatilidade e risco

AVALIAÇÃO

Avaliação da disciplina: critério 7
G1 e G2 com mesmo peso, com prova final

$$N1 = \frac{G1 + G2}{2}$$

se G1 e G2 forem maior ou igual a 3,0 e N1 n
a 6,0

$$NF = N1$$

outros casos o aluno faz a G3:

$$NF = \frac{G1 + G2 + G3 \times 2}{4}$$

G1 e G2 serão compostas por tarefas, testes e prova. O objetivo do curso é oferecer um conhecimento prático. Os alunos terão atividades relacionadas aos capítulos estudados e sua execução, assim como participação em aula, fará parte da avaliação.

**BIBLIOGRAFIA
PRINCIPAL**

- Fundamentals of Futures and Options Markets
Jonh C. Hull Ninth Edition

**BIBLIOGRAFIA
COMPLEMENTAR**

- Mercado de Derivativos no Brasil.
Octavio Bessada, C. Barbedo, G. Araújo. Editora Record
- Investimentos. Bonie, Kane e Marcus

INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES:

Horário e local de Aulas
terças e Quintas de 09:00 às 11:00 hs

Professora: Maria de Nazareth Maciel
Email: nazareth.maciел@econ.puc-rio.br