

# Plano de Ensino

## Finanças I

Daniel Cajueiro

7 de agosto de 2018

### **1 Horário**

Terças e Quintas das 10 as 12.

### **2 Visão geral**

Esse é um primeiro curso de finanças que pretende introduzir as principais questões de finanças explorando a teoria econômica por trás das decisões financeiras. Esse é o ponto de partida para o estudante que pretende estudar finanças seriamente e mandatório para aqueles que pretendem desenvolver tese de doutorado nessa área. Além dessa visão geral de economia financeira, se houver tempo, alguns tópicos de finanças quantitativas e econometria financeira serão incluídos.

### **3 Pre-requisitos**

Espera-se que o estudante domine os resultados básicos de álgebra linear e possua noções de otimização e microeconomia.

### **4 Ementa**

- 1) Mercados completos e mercados incompletos
- 2) Lei do preço único
- 3) Oportunidades de Arbitragem e ausência de oportunidades de arbitragem
- 4) Avaliação de ativos
- 5) Probabilidades neutras ao Risco

- 6) Carteiras Ótimas
- 7) Modelos de Equilíbrio: CAPM e APT
- 8) [Optativo] Tópicos especiais de Finanças Quantitativas
- 9) [Optativo] Tópicos especiais de Econometria Financeira.
- 10) [Optativo] Noções de programação computacional.

## 5 Dinâmica

As aulas serão expositivas. Eventualmente, algum aluno ou outro professor pode ser convidado para dar um seminário especial sobre algum tema específico.

## 6 Avaliação

O curso terá 1 prova (45%), uma nota associada a exercícios (45%) e uma nota associada a participação no curso (10%). A nota associada a exercícios será discutida em sala de aula.

## 7 Referências

J. H. Cochrane Asset Pricing. Princeton University Press, 2005. (Referência complementar)

S. F. LeRoy, J. Werner e S. A. Ross Principles of Financial Economics. Cambridge University Press 2000. (Referencia principal)

## 8 Referências complementares

D. Duffie Dynamic Asset Pricing Theory, Princeton University Press, 2001.

C-F. Huang e R. H. Litzenberger. Foundations for financial economics, Prentice-Hall, 1988.

J. E. Ingersoll Theory of Financial Decision Making, Rowman & Littlefield Publishers, 1987.

M. Magill e M. Quinzii Theory of Incomplete Markets, Vol. 1, The MIT Press, 1996.

[Uma coleção grande de referências associada a parte optativa do curso]