

Plano de Ensino

Finanças I

Daniel Cajueiro

13 de novembro de 2013

1 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.

2 Pre-requisitos

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

3 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

4 Dinâmica

80 % do curso com aula expositiva e possivelmente 20 % com seminários dos alunos – dependendo do número de alunos no curso.

5 Avaliação

O curso terá 1 prova e uma nota associada a seminários. O assunto de cada prova incluirá o conteúdo apresentado até a semana anterior. É importante reforçar nesse momento uma questão importante: **Em nenhuma situação, esse curso terá trabalhos (escritos) nem séries de exercícios valendo nota ou para substituição de provas.**

6 Referências

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

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

[Uma coleção longa de artigos recentes possivelmente será usada para os seminários.]