



INSTITUTO BRASILEIRO DE Ementa do Curso

ENSINO,

DESENVOLVIMENTO E

PESQUISA

Fatos estilizados em Finanças; Retornos no Brasil; Retorno e Risco; Alocação de Capital; Construção de Portfólios; CAPM e APT; Eficiência de Mercado; Asset Pricing e Racionalidade; Finanças Comportamentais; Renda Fixa e ETTJ, Carry Trade.

Objetivos do Curso

PROGRAMA DE

PÓS-GRADUAÇÃO

STRICTO SENSU

EM ECONOMIA

O objetivo deste curso é estudar métodos para a gestão de ativos financeiros. Nós definimos medidas relevantes de risco e retorno, estudamos os resultados de diferentes estratégias, e avaliamos modelos de gestão de ativos. A abordagem do curso é integrar a base analítica com a aplicação prática dos conceitos a partir de exemplos reais de mercado. Alguns tópicos abordados são o CAPM, APT, informação e mercados eficientes, renda fixa, e a relação entre flutuações econômicas e retornos.

Carga Horária: 40h

Créditos: 02

Categoria: Optativa



LEITURAS OBRIGATÓRIAS

Bodie, Kane e Marcus, "Investments", 8^a edição. (BKM)

Antii Ilmanen, "Expected Returns – An Investor's Guide to Harvesting Market Rewards" (ANTII)

John Cochrane, "Asset Pricing" (COCH)

LEITURAS COMPLEMENTARES

Shleifer, Andrei : Inefficient markets: An introduction to behavioral finance (SHLEIFER)

Martellini, Priaulet e Priaulet, "Fixed Income Securities". (MPP)

Elton, Gruber, Brown e Goetzmann, "Modern Portfolio Theory and Investment Analysis"

Campbell, Lo e MacKinlay, "The Econometrics of Financial Markets"
