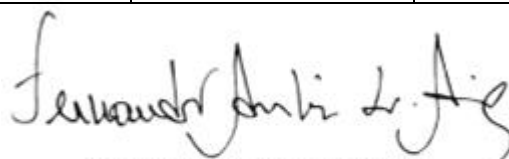


UERJ	EMENTA DA DISCIPLINA	
-------------	-----------------------------	--

UNIDADE ACADÊMICA Faculdade de Ciências Econômicas		DEPARTAMENTO DAQ		
CÓDIGO	NOME DA DISCIPLINA Economia dos Mercados Financeiros	() obrigatória (X) eletiva	CH 60	CRÉD 04
PROGRAMA Pós-Graduação Ciências Econômicas		DISTRIBUIÇÃO DE CARGA HORÁRIA		
CURSO Mestrado Doutorado		TIPO DE AULA	C. HORÁRIA	Nº CRÉDITOS
		TEÓRICA	60	04
		PRÁTICA	-	-
		TOTAL	60	04
PRÉ-REQUISITO: Métodos Quantitativos I				CÓDIGO

EMENTA			
<p>1) Fundamentos do Cálculo Estocástico: conceitos de medida de probabilidade, valor esperado condicional, sigma-álgebra, lema de Itô, integral estocástica, equações diferenciais estocásticas</p> <p>2) Derivativos europeus: modelo de Black Merton e Scholes, gregas, volatilidade implícita</p> <p>3) Mudança de Medida: Teorema de Girsanov, apreçamento pela medida martingal equivalente, teoremas fundamentais de finanças</p> <p>4) Derivativos americanos: tempo de parada, fronteira ótima de exercício</p> <p>5) Mercados futuros: contrato forward, contrato futuro, futuro de commodities, prêmio de risco, opções sobre futuros</p> <p>6) Modelos estocásticos em commodities: modelos de 1 e 2 fatores, filtro de Kalman, estimação dos modelos,</p>			
BIBLIOGRAFIA BÁSICA			
<p>1) Modelos Quantitativos em Finanças com enfoque em commodities, Aiube, Fernando, Editora Bookman, 2013</p> <p>2) Stochastic Calculus for Finance II Continuous-Time Models, Shreve, S. E, Springer 2003</p> <p>3) The Mathematics of Financial Derivatives, Wilmott P, Howison J, Dewynne, J, Cambridge University Press, 1995</p> <p>4) Elementary Stochastic Calculus, with finance in view, Mikosh T, World Scientific 2000</p>			
16) PROFESSOR PROPONENTE		COORDENADOR DO PROGRAMA	
DATA	ASSINATURA/MAT.	DATA	ASSINATURA/MAT.



Prof. Fernando Antonio Lucena Aiube
Programa Pós-Graduação
em Ciências Econômicas
Coordenador Geral
Matricula 38.945-2 FCE/UERJ