



PROGRAMA DE VERÃO FGV EMAP 2019

FINANÇAS QUANTITATIVAS

NÍVEL: Graduação e Mestrado

PROFESSOR: Jorge P. Zubelli

CARGA HORÁRIA: 45h

PERÍODO: 15/01 A 28/02/2019

HORÁRIO: 14h às 15h40min (Ter/Qua/Qui)

LOCAL: 317

EMENTA

Derivativos financeiros: europeus, americanos, exóticos. Princípio de não-arbitragem. Medida neutra ao risco. Apreçamento de derivativos. Fórmula de Black & Scholes. Obrigações (bonds). Hedging. Agências de classificação de risco. Value at Risk (VaR). Modelos e apreçamento de derivativos de taxa de juros, câmbio e commodities. Derivativos de Risco de Crédito. Introdução às Opções Reais. Introdução aos modelos de volatilidade estocástica. Métodos Numéricos: Árvore Binomial; Simulações de Monte Carlo; Métodos de redução de variância; Método de Longstaff-Schwartz.

BIBLIOGRAFIA

Obrigatória:

- Hull, J. (2014). Options, Futures and Other Derivatives. Pearson. 9ª Edição.

Complementar:

- Shreve, S. (2004). Stochastic Calculus for Finance Vol 1. Springer.
- Shreve, S. (2004). Stochastic Calculus for Finance Vol 2. Springer.
- Glasserman, P. (2003). Monte Carlo Methods in Financial Engineering. Springer.
- McNeil, A., Frey, R. e Embrechts, P. (2015). Quantitative Risk Management: Concepts, Techniques and Tools. Princeton. Edição Revisada.

INSCRIÇÕES

ALUNO FGV:

Requerimento Aluno Online

Período de inscrição: 05/12/2018 a 09/01/2019

CANDIDATO EXTERNO:

Inscrições Externas: <https://processoseletivo.fgv.br/Inscricao/CVMFQ>

Período: 05/12/2018 a 09/01/2019

INFORMAÇÕES SOBRE OS CURSOS:

E-mail: emap@fgv.br

Telefone: 3799-5917