

**UNIVERSIDADE FEDERAL DE SANTA CATARINA
CENTRO SOCIOECONÔMICO
PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA**

DISCIPLINA: MERCADO DE CAPITAIS
CÓDIGO: CNM 5126

CARGA HORÁRIA: 60h - CRÉDITOS: 04

OBJETIVO

EMENTA

O curso aborda temas relacionados à economia financeira, incluindo as atitudes dos investidores em relação ao risco, alocação de capital, seleção de carteiras, modelos de precificação de ativos (Capital Asset Pricing Model and Arbitrage Pricing Theory), hipóteses de mercado eficientes, mercados de renda fixa e mercados de futuros e opções.

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

- John H. Cochrane (2005). Asset Pricing. Princeton University Press.
- John Y. Campbell (2018). Financial Decisions and Markets: A course in asset pricing. Princeton University Press.
- Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus (2017). Investments. McGraw-Hill Education; 11a edition.
- Gerard Cornuejols & Reha Tütüncü (2007). Optimization Methods in Finance. Cambridge University Press.
- Frank J. Fabozzi, Petter N. Kolm, Dessislava Pachamanova, & Sergio M. Focardi (2007). Robust Portfolio Optimization and Management. Wiley
- Danthie, J.P. & Donaldson, J.B. (2013). Intermediate Financial Theory, Third Edition. Elsevier Academic Press Advanced Finance.
- Kerry Back. (2010). A Course in Derivative Securities: Introduction to Theory and Computation. Springer Finance Textbooks.