



EMENTA E PROGRAMA DE DISCIPLINA

Nome: ESTATÍSTICA EM FINANÇAS II

Código: GET00101

Carga horária semestral

Total: 68 horas

Teórica: 50 horas

Prática: 18 horas

Validade: A partir de 2012

Ementa:

Sistema Financeiro Nacional; Tipos de Mercado; Instrumentos de Negociações; Escolas de Análise de Investimentos; Aplicações de ferramentas estatísticas em Finanças

Programa:

- 1) Sistema Financeiro Nacional: reguladores e intermediadores;
- 2) Tipos de Mercado: Cambial, Monetário, Crédito e Capitais;
- 3) Instrumentos de Negociações: A termo, A vista, Derivativos e Futuros;
- 4) Escolas de Análise de Investimentos: Análise Fundamentalista e Técnica;
- 5) Aplicações das ferramentas Estatística em Finanças:
 - a) Modelagem da curva spot de juros;
 - b) Modelagem da inflação implícita;
 - c) Modelos de concessão de crédito;
 - d) Modelos de Risco de Crédito calculados por Monte Carlo;
 - e) Modelagem de indicadores técnicos de ativos financeiros;
 - f) Modelagem do VaR (Value at Risk) Normal e Empírico para ativos financeiros de renda variável;
 - g) Otimização de Carteiras;

Bibliografia

- 1) Lima, G. (2006). *Curso de Mercado Financeiro: Tópicos especiais*, Atlas.
- 2) Lima, A. (2007). *MERCADO FINANCEIRO: Aspectos Conceituais e Históricos*, Atlas..
- 3) Santos, J. (1999). *MERCADO FINANCEIRO BRASILEIRO: Instituições e Instrumentos*, Atlas.
- 4) Carmona C. (2009) *FINANÇAS CORPORATIVAS E MERCADOS*, Atlas.
- 5) Jorion, Philippe. (2003) *Value at risk.- The New Benchmark for Managing Financial Risk* 3a. New York: Edition. McGraw-Hill, 2007.
- 7) Silva, J. (2000) *Gestão e a Análise de Risco de Crédito*, Atlas

ANA MARIA LIMA DE FARIAS

Chefe-Deptº Estatística

SIAPE 0311506