

Ficha 1 (permanente)

Disciplina: Modelos Matemáticos em Finanças						Código: CMI101	
Natureza: () Obrigatória (X) Optativa			(X) Semestral () Anual () Modular				
Pré-requisito: -		Co-requisito: -		Modalidade: (X) Presencial () Totalmente EaD ()..... % EaD*			
CH Total: 60 CH semanal: 04	Padrão (PD): 60	Laboratório (LB): 0	Campo (CP): 0	Estágio (ES): 0	Orientada (OR): 0	Prática Específica (PE): 0	Estágio de Formação Pedagógica (EFP): 0
EMENTA (Unidade Didática)							
<p>Definições básicas do mercado financeiro: bolsas e principais índices. Análise de carteiras: introduzindo portfolio, retorno de um título e carteiras, risco de um título e carteiras. O modelo da média variância de Markowitz: carteiras com e sem venda a descoberto, o uso de multiplicadores de Lagrange, fronteira eficiente. Modelo de índice único (beta de uma carteira): variância de uma carteira utilizando o beta, estimação de beta histórico. Conceitos de opções e mercados futuros: introduzindo opções, opções tradicionais e exóticas.</p>							
Chefe de Departamento ou Unidade equivalente: Prof. José Carlos Corrêa Eidam _____							
Assinatura: _____							

*OBS (1): ao assinalar a opção % EAD, indicar a carga horária que será à distância.

[ATENÇÃO: ANEXAR BIBLIOGRAFIA DESTA FICHA 1 NA FOLHA SEGUINTE]

Art. 9º da Resolução 30/90 – CEPE

Padrão (PD): conjunto de estudos e atividades desenvolvidos fundamentalmente nos espaços de aprendizagem considerados padrão para as modalidades de ensino presencial e de educação à distância (EAD).

Laboratório (LB): conjunto de estudos e atividades desenvolvidos fundamentalmente em espaços de aprendizagem estabelecidos com infraestrutura especializada, tais como laboratórios, oficinas e estúdios.

Campo (CP): conjunto de estudos e atividades desenvolvidos fundamentalmente mediante atividades de campo.

Estágio (ES): conjunto de estudos e atividades desenvolvidos fundamentalmente em ambientes de trabalho mediante estágios regulados pela Lei nº 11.778, de 25 de setembro de 2008.

Orientada (OR): conjunto de estudos e atividades direcionados à vivência na atuação acadêmica e/ou profissional, em seus mais amplos aspectos, desenvolvidos em espaços educacionais internos e/ou externos à UFPR, com a participação direta de docente responsável.

Práticas Específicas (PE): conjunto de atividades de natureza prática, desenvolvidas em ambientes que apresentem restrições ao quantitativo de alunos por docente e que exijam controle rigoroso envolvendo questões de segurança, dignidade, privacidade e sigilo e/ou atenção do docente individualizada ou a pequenos grupos para desenvolvimento do processo de ensino-aprendizagem, com a participação direta do docente responsável.

Estágio de Formação Pedagógica (EFP): conjunto de estudos e atividades desenvolvidas fundamentalmente no âmbito da educação básica, sob a forma de “práticas de docência” e “práticas pedagógicas de organização do trabalho escolar”, envolvendo a orientação direta docente em ações que vão desde a intermediação no acordo de colaboração entre a UFPR e os estabelecimentos de ensino, até o acompanhamento sistemático e processual do planejamento, da execução e da avaliação das atividades desenvolvidas pelos licenciandos, o que requer o contato contínuo e presencial do professor nos diferentes campos de estágio e conseqüentemente a limitação de alunos por turma.

BIBLIOGRAFIA BÁSICA (mínimo 03 títulos)

1. Edwin, J. E. *et alli*, *Moderna Teoria de Carteiras e Análise de Investimentos*, 1a. ed., São Paulo: Atlas, 2004.
2. Fonseca, M. A. R., *Álgebra Linear Aplicada a Finanças, Economia e Econometria*, Barueri (SP): Manole Ltda, 2003.
3. Markowitz, H. M., *Portfolio Selection - Efficient diversification of investments*, Yale University Press, 1954

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR (mínimo 05 títulos)

1. Sharp, W. F., Alexander G. J., *Investments*, 4th. ed., Prentice-hall, 1978.
2. Securato, J.R., *Decisões financeiras em condições de risco*, São Paulo: Atlas, 1993.
3. Silva Neto, L. A., *Opções - do tradicional ao exótico*, 2a. ed., São Paulo: Atlas, 1996.