

**EAE516 – Mercados de Derivativos –
2017**

Professor: Alan De Genaro (adg@usp.br, FEA 2, sala 252)

Objetivos:

O curso visa capacitar os alunos(as) a compreender o funcionamento dos principais instrumentos derivativos negociados no Brasil.

Tópicos:

- Participantes do Mercado;
- Conceitos e fundamentos dos mercados Futuro e a Termo;
- Apreçamento de ativos por arbitragem
- Futuros sobre Moedas e Índices de Ações.
- Futuro de taxas de juros (em BRL e USD)
- Mercado de Opções.
- Certificado de Operações Estruturadas (COE)
- Swaps.

Horário de atendimento: Terças e quintas das 18:30 às 19:30.

Método de avaliação

- Uma prova intermediária: peso 50%
- Um trabalho final de curso: peso 40%
- Quiz: peso 10%

Bibliografia:

- Santos, J. C. S & Silva, M. E. (2015) DERIVATIVOS E RENDA FIXA: Teoria e Aplicações ao Mercado Brasileiro. Editora Atlas
- Martins, André. Mercados Derivativos e Análise de Risco volumes 1 e 2. Editora MAS
- Hull, John. Opções, futuros outros derivativos. Editora B&MF – Cultura Editores Associados (a versão em inglês é mais atual)
- Oliveira, Gilson e Pacheco, Marcelo. Mercado Financeiro: Objetivo e Profissional. Editora Fundamento