



UNIVERSIDADE ESTADUAL DE CAMPINAS

Instituto de Economia

Grupo de Mercado Financeiro da Unicamp - GMF/UNICAMP

Nome da disciplina: Curso de Derivativos - ECO1501

Carga horária total: 12 horas

1. Objetivos do curso

Introduzir os participantes aos conceitos de derivativos, capacitando-os a entender esses instrumentos para gestão de riscos e otimização de estratégias financeiras.

2. Ementa do curso

Aula 1: Introdução aos derivativos - 22/10

- a) Introdução ao curso e ao GMF
- b) O que são derivativos e quem os utiliza
- c) Tipos de derivativos
- d) Como são negociados
- e) Histórias envolvendo derivativos
- f) Fórmula do Dinheiro no Tempo

Aula 2: Contrato a Termo - 29/10

- a) Revisão de conceitos
- b) Contrato a termo
- c) Como é feito na prática
- d) Histórias envolvendo contratos a termo

Aula 3: Contrato Futuro I - 05/11

- a) Revisão de conceitos
- b) Contrato Futuro
- c) Precificação
- d) Histórias envolvendo contratos futuros

Aula 4: Contrato Futuro II - 12/11

- a) Revisão
- b) Formação de preço
- c) Taxa de Juros
- d) O mundo dos contratos futuros
- e) Exemplos reais

Aula 5: Swaps - 19/11

- a) Conceitos Iniciais
- b) Plain-Vanilla
- c) Câmbio, commodities e precificação
- d) TROR e CDS

Aula 6: Crise de 2008 - 26/11 - (online)

- a) Contexto histórico
- b) A bolha
- c) Instrumentos
- d) Consequências

Aula 7: Opções I - 01/12 (online)

- a) Conceitos Iniciais
- b) Tipos e terminologias
- c) Valores

Aula 8: Opções II - 03/12 (online)

- a) Paridade Put-call
- b) Precificação de opções
- c) Gregas

Aula 9: Gestão de Carteiras - 08/12 (online)

- a) Teoria Moderna do Portfólio
- b) Risco e Retorno
- c) Aplicação em carteiras
- d) Fronteira Eficiente
- e) CML: Capital Market Line
- f) VaR

Aula 10: Encerramento - 10/12 (online)