

## =FUNDAÇÃO GETÚLIO VARGAS

**DEPARTAMENTO.....: CONTABILIDADE, FINANÇAS E CONTROLE (CFC)**

**CURSO.....: CMA/CDA**

**DISCIPLINA.....: MÉTODOS EMPÍRICOS EM FINANÇAS**

**PROFESSOR.....: WILLIAM EID JR**

**Semestre: 1º/05**

### PROGRAMA

#### OBJETIVOS DO CURSO

Este curso pretende dar uma visão geral de pesquisa empírica em finanças abordando uma parte dos tópicos que tem sido objeto de estudos no mundo acadêmico. O foco principal são textos recentes sendo que para cada tópico serão discutidos algumas pesquisas recentes além do livro texto quando aplicável.

#### CONTEÚDO

- 1 Introdução
- 2 Previsão em mercados financeiros
- 3 Estudo de evento
- 4 Volatilidade
- 5 CAPM
- 6 Modelos multifatores
- 7 Relações de valores presentes
- 8 Listagem em bolsa
- 9 Modelos de derivativos
- 10 Renda fixa
- 11 Fundos de investimentos
- 12 Finanças comportamentais
- 13 Custo e estrutura de capital
- 14 Gestão de risco
- 15 Listagem em bolsa
- 16 Não linearidade

#### METODOLOGIA

O programa será desenvolvido fundamentado nas exposições do professor e apresentação de artigos pelos alunos. A leitura dos trabalhos a serem apresentados é fundamental para o bom aproveitamento do curso.

#### CRITÉRIOS DE AVALIAÇÃO

|                     |     |
|---------------------|-----|
| Participação/testes | 20% |
| Artigo semestral    | 30% |
| Prova parcial       | 20% |
| Exame final         | 30% |

#### BIBLIOGRAFIA

Livro Texto:

Campbell, Lo, MacKinlay - The Econometrics of Financial Markets