

**COG818**

**RISCOS FINANCEIROS, OPÇÕES E OUTROS DERIVATIVOS**

Análise de carteiras: conjuntos de oportunidades sob risco, carteiras eficientes, técnicas para calcular a fronteira eficiente, modelo de índice único, modelo de índice múltiplo e técnicas de grupamento; modelos de equilíbrio dos mercados de capital: CAPM padrão, CAPM não padrão, testes empíricos, APT (*arbitrage pricing model*); análise de títulos e teoria das carteiras; avaliação do desempenho da carteira. Mercados futuros e a utilização de futuros para hedge; mercado de opções e estratégias; comportamento do preço de opções; a análise de Black-Scholes-Merton; precificação de derivativos; aplicações ao setor energético.

