

PROGRAMA DE MESTRADO E DOUTORADO EM ECONOMIA
CURSO DE:

FINANÇAS ECONOMETRÍCAS E AVALIAÇÃO DE RISCO

PROFESSOR MICHAEL MCALEER

ECONOMETRIC INSTITUTE, ERASMUS SCHOOL OF ECONOMICS
ERASMUS UNIVERSITY ROTTERDAM AND TINBERGEN INSTITUTE, THE NETHERLANDS

PROGRAMA PRELIMINAR

MODELLING FINANCIAL VOLATILITY
CONDITIONAL VOLATILITY OR GENERALISED AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL HETEROSKEDASTICITY
STOCHASTIC VOLATILITY
REALIZED VOLATILITY
CAPM AND THE TERM STRUCTURE OF INTEREST RATES
OPTIONS, FUTURES AND SWAPS

PÚBLICO ALVO

ALUNOS DE MESTRADO E DOUTORADO EM ECONOMIA E ÁREAS AFINS, PROFESSORES, PESQUISADORES,
ANALISTAS ECONÔMICOS E FORMULADORES DE POLÍTICAS.

CERTIFICAÇÃO

TODOS OS ALUNOS QUE CUMPIREM COM AS EXIGÊNCIAS DO CURSO RECEBERÃO UM CERTIFICADO DE
PARTICIPAÇÃO OFERECIDO PELO PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO STRICTU SENSU EM ECONOMIA DA UCB

INSCRIÇÕES:

LOCAL: SECRETARIA ACADÊMICA DA PÓS-GRADUAÇÃO . SGAN 916 MÓDULO "B"
TELEFONE: (61)3448-7127 E (61)3448-7151
SITE: WWW.UCB.BR/POSECONOMIA
PERÍODO: 1º A 30 DE NOVEMBRO DE 2011
HORÁRIO: 09:00 ÀS 17:00

INFORMAÇÕES GERAIS

CARGA HORÁRIA: 30 HORAS
PERÍODO: 1º A 28 DE FEVEREIRO DE 2012
AULAS: SEGUNDA A SEXTA-FEIRA DAS 19H20 ÀS 21H20
IDIOMA: CURSO EM INGLÊS
MATERIAL DIDÁTICO: SERÁ OFERECIDO AOS PARTICIPANTES

INFORMAÇÕES ADICIONAIS: PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA DA UCB, SGAN 916, MÓDULO B, BRASÍLIA DF
TEL: (61)3448-7127, (61)3448-7151, SITE: WWW.UCB.BR/POSECONOMIA