



ESCOLA DE
ECONOMIA DE
SÃO PAULO

MESTRADO
PROFISSIONAL
EM ECONOMIA



Ênfase em Banking
(Economia e Finanças Bancárias)

vire
aqui

DISCIPLINAS

MATEMÁTICA

Esta disciplina tem como objetivo apresentar aos alunos o instrumental matemático necessário para o acompanhamento das demais disciplinas do mestrado, ressaltando a utilização desse instrumental em modelos econômicos e financeiros de um modo geral. O curso cobre os principais tópicos de cálculo diferencial e integral, otimização e outros métodos aplicados na análise econômica.

ESTATÍSTICA

Objetiva desenvolver a capacidade de análise estatística dos participantes, apresentando-lhes os fundamentos da inferência estatística. Apresentar técnicas estatísticas necessárias para dar condições do aprendizado posterior de econometria. Os tópicos principais incluem probabilidade, distribuições, testes de hipótese, estimação, análise de variância e outros métodos relevantes para a análise estatística e econométrica.

MICROECONOMIA

O curso apresenta os principais tópicos da teoria microeconômica com foco em posteriores aplicações. Cobre a teoria do consumidor, teoria de firma e análise de equilíbrio de mercado. Outros tópicos relevantes tratados no curso são otimização, preferências e utilidade, estratégias de precificação, estruturas de mercado e economia do bem estar. Informação assimétrica. Risco Moral. Seleção Adversa. Introdução a Teoria dos Jogos.

MACROECONOMIA

O objetivo do curso é desenvolver o instrumental analítico de Macroeconomia de modo a facilitar o entendimento do funcionamento da economia em nível agregado e seus principais problemas. O curso trata da determinação do nível de produção, renda e demanda agregada no curto prazo. Analisa também os agregados econômicos, com destaque para inflação, desemprego, taxa de juros e taxa de câmbio. Diferentes escolas de pensamento macro são também comparadas. A disciplina cobre o modelo IS-PC-MR novo-keynesiano (curva IS, Curva de Philips, regra monetária), entre outros.

ECONOMETRIA

A disciplina de Econometria pretende apresentar aos alunos uma visão abrangente dos princípios fundamentais de estatística empregados na análise quantitativa em Economia. Também busca habilitar os alunos a realizar análises empíricas e aplicadas de teorias das referidas áreas de conhecimento. Os tópicos da Econometria cobertos pelo curso são: o modelo clássico de regressão linear, inferência estatística, problemas de especificação e de resíduos, propriedades do método de mínimos quadrados ordinários para amostras finitas, método do momento generalizado, variáveis dummy, variáveis instrumentais, e introdução a modelos de dados de painel.

GESTÃO DE BANCOS E INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS

Esta disciplina tem como objetivo apresentar e discutir os modelos de gestão econômico-financeira de bancos, e de conglomerados financeiros. Para tal são abordados os seguintes assuntos: fundamentos da gestão de instituições financeiras (bancos de varejo, de atacado, de investimento, seguradoras, etc.); demonstrações financeiras de bancos e seguradoras; a questão e impactos da alavancagem nos negócios bancários; maximização de valor na atividade bancária; impactos da regulação e Acordo da Basileia na gestão de instituições financeiras; o papel do crédito no banco; produtos e instrumentos de captações e aplicações de recursos; fontes de receitas e despesas na atividade bancária, indicadores de gestão e desempenho no setor bancário, papel da tesouraria no banco, asset and liability management (ALM), dentre outros.

GESTÃO DE RISCOS DE INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS

A disciplina aborda os principais riscos inerentes à atividade bancária e de instituições financeiras, bem como os modelos, técnicas, e instrumentos para sua gestão, tanto de forma individual como integrada. No decorrer da disciplina são discutidos temas tais como: riscos financeiros e não-financeiros (risco de mercado, risco de crédito, risco de liquidez, risco operacional, risco de imagem, dentre outros); gestão integrada de riscos; principais ferramentas de mensuração e gerenciamento de riscos; Value-at-risk (VaR) e seus modelos de estimação; compliance e sua importância na gestão de riscos; alocação de capital; medidas de desempenho e seus impactos na instituição financeira em função da estratégia de gestão de riscos.

MICROECONOMIA BANCÁRIA

A disciplina utiliza abordagem de organização industrial, assimetria de informação, teoria de contratos e outros avanços da moderna microeconomia para explicar o papel dos bancos na economia. A disciplina fornece uma descrição das funções dos bancos e explica a necessidade de intermediação financeira. A ênfase é sobre as deficiências

estruturais do setor bancário que podem justificar intervenções públicas. A disciplina trata da contratação ótima entre credor e devedor, a persistência de racionamento no mercado de crédito, o uso da garantia e os problemas de solvência. São discutidos aspectos como, por exemplo: regulação bancária, concorrência no setor bancário, reputação no mercado de crédito, relacionamento credor-devedor, contratos ótimos, e modelos empíricos em microeconomia bancária, dentre outros.

ENGENHARIA FINANCEIRA

A disciplina oferece a possibilidade de que seja reconhecido o elevado valor do raciocínio de avaliação de opções na solução de problemas reais. Os problemas do mundo real que são analisados incluem: gestão de risco de mercado e crédito; avaliação de investimentos; desenho de contratos para dirimir diferenças de avaliação entre as partes; desenho de programas de incentivos para gestores de empresas. Além disso, técnicas de mensuração e gestão de risco de mercado e risco de crédito, com o uso de derivativos, são abordadas durante a disciplina. As aplicações são demonstradas através da discussão de estudos de caso.

RISCO OPERACIONAL

Apresentação de modelo de quantificação de risco operacional pela abordagem de distribuição de perdas. Conceituação e aplicação de modelos de controle de risco operacional na solução de problemas e redução de perdas financeiras das empresas. São abordados temas como, por exemplo: gestão de risco operacional, como elaborar políticas e procedimentos, fronteira com risco de mercado: tesouraria e backoffice, três linhas de defesa e validação de modelos, quantificação de risco operacional, gestão de risco legal, fronteira com risco de crédito: controle de fraudes, gestão do risco de tecnologia da informação, terceirização.

OUTRAS ELETIVAS:

Compliance em Instituições Financeiras, International Banking, Modelos Quantitativos de Gestão de Crédito, Seguros e Previdência, Investment Banking, Asset Management, Econometria de Séries Financeiras, etc.

SEMINÁRIO DE DISSERTAÇÃO

O objetivo da disciplina é orientar os alunos para a elaboração de dissertação de mestrado. O curso aborda técnicas de pesquisa, discussões de metodologia em economia e passos necessários para a elaboração de um bom trabalho de pesquisa. Durante os seminários, os alunos apresentam também o andamento de seus trabalhos para receber críticas, comentários e sugestões dos professores do programa.

www.fgv.br/eesp



Escola de Economia de São Paulo da Fundação Getúlio Vargas

Rua Itapeva, 474 - 13º andar - Bela Vista - CEP: 01332-000

Tel: (11) 3799 3453 | economia@fgv.br | www.fgv.br/eesp



FGV/EESP



FGV.EESP



FGV/EESP