

Mapa das sessões ordinárias

Detailed Map of Sessions

Sábado, 06 de julho - 08:30/10:30

Saturday, 06 july

Sessão 17: Liquidez e Risco Session 17		Coordenador: Henrique Pinto Ramos Coordinator		Sala: 224 Classroom
Horário Time	Título Title	Autores Authors	Apresentador Presenter	Debatedor Discussant
08:30-09:00	Apreçamento de Debêntures Ilíquidas Utilizando Redes Neurais e Clusterização	Afonso de Campos Pinto, Élia Yathie Matsumoto, Marcela Sousa Zuppini	Marcela Sousa Zuppini	Henrique Pinto Ramos
09:00-09:30	An empirical investigation of Coverage and structural change tests in a Value at Risk analysis based on quantile regression estimation	Raydonal Ospina, Wilton Bernardino, Yuri Martí Santana Santos	Wilton Bernardino	Marcela Sousa Zuppini
09:30-10:00	Ajuste para Liquidez no Período de Manutenção do Value-at-Risk	Felipe Noronha Tavares, João Marco Braga da Cunha	João Marco Braga da Cunha	Wilton Bernardino
10:00-10:30	Semi-deviation-based measures of liquidity	Henrique Pinto Ramos, Marcelo Brutti Righi	Henrique Pinto Ramos	João Marco Braga da Cunha

Sessão 18: Volatilidade Session 18		Coordenador: Omar Abbara Coordinator		Sala: 228 Classroom
Horário Time	Título Title	Autores Authors	Apresentador Presenter	Debatedor Discussant
08:30-09:00	Estimating long memory stochastic volatility model using integrated nested Laplace approximations	Márcio P. Laurini, Pedro Chaim	Pedro Chaim	Allan Jonathan da Silva
09:00-09:30	On the stochastic correlated square-root diffusion process and applications	Allan Jonathan da Silva, Jack Baczynski, José V. M. Vicente	Allan Jonathan da Silva	André Nunes Maranhão
09:30-10:00	Corporate governance and volatility: Spillover and Lead-Lag effects using multivariate GARCH model and Granger-Causality of second order.	André Nunes Maranhão	André Nunes Maranhão	Omar Abbara
10:00-10:30	Modeling and forecasting long memory stochastic volatility	Mauricio Zavallos, Omar Abbara	Omar Abbara	Pedro Chaim

Horário Time	Título Title	Autores Authors	Apresentador Presenter	Debatedor Discussant
08:30-09:00	Unconventional US monetary policy and international spillovers: assessing the impact in Brazil using a GVAR approach 2007-2017	Andre de Melo Modenesi, George Augusto Noronha Morcerf, Osmani Teixeira de Carvalho Guillén, Tarciso Gouveia da Silva	Tarciso Gouveia da Silva	Diego Silveira Pacheco de Oliveira
09:00-09:30	Currency Returns and Interest Rate Slopes	Pedro Castro, Ruy Ribeiro	Pedro Castro	Raphael Zhou Ching
09:30-10:00	The effect of sovereign risk perception on the disagreement in expectations about the exchange rate	Diego Silveira Pacheco de Oliveira, Gabriel Caldas Montes	Diego Silveira Pacheco de Oliveira	Tarciso Gouveia da Silva
10:00-10:30	Efeitos das intervenções do Banco Central sobre a volatilidade e a gestão do risco de mercado da taxa de câmbio no Brasil	Leandro Maciel, Raphael Zhou Ching	Raphael Zhou Ching	Pedro Castro

Horário Time	Título Title	Autores Authors	Apresentador Presenter	Debatedor Discussant
08:30-09:00	Home bias in the equities portfolio: the Brazilian case	Diogo Guillén, Franciane Dal Col	Franciane Dal Col	Thiago de Oliveira Souza
09:00-09:30	Portfólios por Reamostragem Condicional aos Fatores	André Barbosa Oliveira, Pedro Luiz Valls Pereira	André Barbosa Oliveira	Paulo Ferreira Naibert
09:30-10:00	Tangency Portfolio: A Critique	João Caldeira, Paulo Ferreira Naibert	Paulo Ferreira Naibert	Franciane Dal Col
10:00-10:30	Time-varying factor risk and price of risk premiums	Thiago de Oliveira Souza	Thiago de Oliveira Souza	André Barbosa Oliveira

Horário Time	Título Title	Autores Authors	Apresentador Presenter	Debatedor Discussant
08:30-09:00	Modeling Capacity Expansion Options in Government Road Concessions	Carlos Bastian-Pinto, Luiz E. Brandão, Naielly Lopes Marques, Rafael Igrejas	Naielly Lopes Marques	Felipe V. de S Araujo
09:00-09:30	Bitcoin in Brazil: Law of One Price and Price Discovery in an Emerging Market	Daniel Modenesi de Andrade, Fabio Motoki, Fernando Barros Jr, Matheus Oliveira da Silva	Fabio Motoki	Pedro Piccoli
09:30-10:00	Bit-Spread - a real option approach to value bitcoin mining as hedge for electricity sale in the open market	Carlos Bastian-Pinto, Felipe V. de S Araujo, Leonardo Lima Gomes, Luiz E. Brandão	Felipe V. de S Araujo	Naielly Lopes Marques
10:00-10:30	Dynamic Relationship of Cryptocurrency Prices and Investor Attention	Mo Chaudhury, Pedro Piccoli	Pedro Piccoli	Fabio Motoki