

Mapa das sessões ordinárias

Detailed Map of Sessions

Sexta-feira, 05 de julho - 13:45/15:45

Friday, 05 july

Sessão 11: Liquidez Session 11		Coordenador: Alan De Genaro Coordinator		Sala: 224 Classroom	
Horário Time	Título Title	Autores Authors	Apresentador Presenter	Debatedor Discussant	
13:45-14:15	Liquidity and algorithmic trading in Brazil	Henrique Pinto Ramos, Marcelo Scherer Perlin	Henrique Pinto Ramos	Eduardo Camilo da Silva	
14:15-14:45	Short-selling costs and asymmetric price response to economic shocks	Jose Renato Haas Ornelas, Pablo Jose Campos de Carvalho	Jose Renato Haas Ornelas	Alan De Genaro	
14:45-15:15	TRADING IMBALANCE, LIQUIDITY AND STOCK RETURNS: EVIDENCE FROM BRAZIL	Claudio Henrique da Silveira Barbedo, Eduardo Camilo-da-Silva, Gustavo Magno Lopes Pereira	Eduardo Camilo da Silva	Jose Renato Haas Ornelas	
15:15-15:45	Market Impact for Brazil equity market	Alan De Genaro	Alan De Genaro	Henrique Pinto Ramos	

Sessão 12: Fixed income and credit markets (English) Session 12		Coordenador: Bruno P. Lund Coordinator		Sala: 228 Classroom	
Horário Time	Título Title	Autores Authors	Apresentador Presenter	Debatedor Discussant	
13:45-14:15	CoCo Bonds and Systemic Risk	Jose Fajardo, Layla dos Santos Mendes	Layla dos Santos Mendes	Bruno Pereira Lund	
14:15-14:45	Does the CDS market anticipate changes in firm risk?	Dirk Schiereck, Florian Kiesel, Lars Norden, Sascha Kolaric	Lars Norden	Rafael Baptista Pallazzi	
14:45-15:15	Evaluation of mechanism design of auctions: Proposal for the Brazilian Government Bonds Market	Antonio Carlos Figueiredo Pinto, Marcelo Cabús Klötzle, Rafael Baptista Pallazzi, Waldemar Antônio da Rocha de Souza	Rafael Baptista Pallazzi	Layla dos Santos Mendes	
15:15-15:45	Asset allocation for Deposit Insurers	Bruno Pereira Lund, Lucas Campos Pires	Bruno Pereira Lund	Lars Norden	

Horário Time	Título Title	Autores Authors	Apresentador Presenter	Debatedor Discussant
13:45-14:15	Estrutura de Capital, Governança Corporativa e Rating Soberano: Um Estudo Sobre a Alavancagem e o Desempenho das Empresas Brasileiras Listadas na B3	Duterval Jesuka, Fernanda Maciel Peixoto, Guilherme Freitas Cardoso	Duterval Jesuka	Marcelo S. Perlin
13:45-14:15	Does the deviation from the rule 'one share one vote' induce financial constraint?	Alberto Granzotto, Igor Bernardi Souza	Alberto Granzotto	Mauro Mastella
14:45-15:15	The Impact of Board Gender-Diversity in Brazilian Firms Performance and Risk	Daniel Vancin, Guilherme Kirch, Marcelo Perlin, Mauro Mastella	Mauro Mastella	Alberto Granzotto
15:15-15:45	A Ciência nos Conselhos Corporativos: O Efeito da Titulação e Produção Científica no Desempenho das Empresas Brasileiras	Daniel Vancin, Guilherme Kirch, Marcelo S. Perlin, Mauro Mastella	Marcelo S. Perlin	Duterval Jesuka

Horário Time	Título Title	Autores Authors	Apresentador Presenter	Debatedor Discussant
13:45-14:15	Elasticity of Intertemporal Substitution with Unfiltered Consumption	Carlos Carvalho, Marcus Vinicius Castro, Ruy Ribeiro	Marcus Vinicius Castro	Jose Luiz Rossi Junior
14:15-14:45	Breakeven Inflation Rate Estimation: An Alternative Approach Considering Indexation Lag and Seasonality	Flávio de Freitas Val, Gustavo Silva Araujo	Gustavo Silva Araujo	Tarciso Gouveia da Silva
14:45-15:15	Effects of monetary policy news on the behavior of financial assets: evidence from Brazil before and after the global crisis based on a bivariate VAR-GARCH model (2006-17)	Andre de Melo Modenesi, George Augusto Noronha Morcerf, Osmani Teixeira de Carvalho Guillén, TARCISO GOUVEIA DA SILVA	Tarciso Gouveia da Silva	Marcus Vinicius Castro
15:15-15:45	TRANSMISSION OF MONETARY POLICY THROUGH THE WEALTH CHANNEL IN BRAZIL: DOES THE TYPE OF ASSET MATTER?	Daniel Carvalho Cunha, Jose Luiz Rossi Junior, Marina Rossi	Jose Luiz Rossi Junior	Gustavo Silva Araujo

Horário Time	Título Title	Autores Authors	Apresentador Presenter	Debatedor Discussant
13:45-14:15	Explorando a Anomalia da Baixa Volatilidade	Axel Simonsen, Carlos Magno Gonçalves Fernandes Reis, Daniela Kubudi	Carlos Magno Gonçalves Fernandes Reis	Lemuel de Lemos Romão
14:15-14:45	Estratégias de pares por cointegração parcial: Evidências para o mercado brasileiro	Anderson Luiz Rezende Mól, Lemuel de Lemos Romão, Rodrigo Raposo da Fonseca, Ruan Rodrigo Araújo da Costa	Lemuel de Lemos Romão	Marcelo Guzella
14:45-15:15	Efeito da Atenção do Investidor na Eficiência do Mercado de Ações Brasileiro	Henrique Castro, Marcelo Guzella	Marcelo Guzella	Thiago de Oliveira Souza
15:15-15:45	A critique of momentum anomalies	Thiago de Oliveira Souza	Thiago de Oliveira Souza	Carlos Magno Gonçalves Fernandes Reis

Horário Time	Título Title	Autores Authors	Apresentador Presenter	Debatedor Discussant
13:45-14:15	Classe de modelos Nelson-Siegel com parâmetros variando no tempo: ajuste e previsão da estrutura a termo da taxa de juros	André A. P. Santos, WERLEY DA COSTA CORDEIRO	Werley da Costa Cordeiro	Renata Tavanielli
14:15-14:45	On the subprime crisis and the Latin American financial markets: A regime switching skew-normal approach	Andreza Aparecida Palma, Diego Ferreira	Andreza Aparecida Palma	Luiz Henrique Moraes da Silva
14:45-15:15	Modelos de taxa de juros a termo com mudanças de regime	Márcio Poletti Laurini, Renata Tavanielli	Renata Tavanielli	Werley da Costa Cordeiro
15:15-15:45	Modelo HJM Multifatorial Integrado com Distribuições Empíricas Condicionais: o Caso Brasileiro	Afonso de Campos Pinto, Luiz Henrique Moraes da Silva	Luiz Henrique Moraes da Silva	Andreza Aparecida Palma