

# 14º Encontro Brasileiro de Finanças

## Mapa das sessões ordinárias

**25 de julho de 2014 - Sexta-feira**

**13:45 - 15:45**

D&R-2 e EMN-4: Derivativos e Riscos e Econometria e Métodos Numéricos em Finanças		Coordenador: Rafael Schiozer	Sala E6	
ID	Título	Autores	Apresentador	Debatedor
4528	Nonparametric Tail Risk and Stock Returns: Predictability and Risk-Premia	Osmani Teixeira de C. Guillen, Caio Almeida, José Valentim M. Vicente	Osmani Teixeira de C. Guillen	Márcio Poletti Laurini
4651	A Discrete Monitoring Method for Pricing Brazilian Interest Rate Options and a New Finite Difference Implicit Scheme	Allan Jonathan da Silva, Jack Baczynski, José Valentim M. Vicente	Allan Jonathan da Silva	Adriano Faria
4373	Previsão da estrutura a termo brasileira utilizando fatores macroeconômicos	Adriano Faria, Caio Almeida	Adriano Faria	Osmani Teixeira de C. Guillen
4418	Modelagem de Curvas de Juros Usando Amostragem de Frequências Mistas	Márcio Poletti Laurini, Ana Carolina Santana Minioli	Márcio Poletti Laurini	Allan Jonathan da Silva

EMN-5: Econometria e Métodos Numéricos em Finanças		Coordenador: Emerson Fernandes Marçal	Sala E1	
ID	Título	Autores	Apresentador	Debatedor
4516	Predicting the yield curve using forecast combinations	João Frois Caldeira, Guilherme V. Moura, André Portela Santos	João Frois Caldeira	Gabriel Filipe R. Vasconcelos
4556	Assessing Interdependence Among Countries' Fundamentals and Its Implications for Exchange Rate Misalignment Estimates: An Empirical Exercise Based on GVAR	Emerson Fernandes Marçal, Diogo De Prince, Giovanni Merlin, Beatrice Zimmerman	Emerson Fernandes Marçal	Cássio Nóbrega Besarria
4582	Como o Banco Central tem reagido aos choques (bolhas) nos preços das habitações brasileiras? Uma análise por meio por meio do modelo dinâmico estocástico de equilíbrio geral (DSGE)	Cássio Nóbrega Besarria, Nelson Leitão Paes, Marcelo Eduardo Silva	Cássio Nóbrega Besarria	João Frois Caldeira
4591	Parametric Portfolio Selection in the Brazilian Market	Marcelo C. Medeiros, Arthur M. Passos, Gabriel Filipe R. Vasconcelos	Gabriel Filipe R. Vasconcelos	Emerson Fernandes Marçal

EMN-6: Econometria e Métodos Numéricos em Finanças		Coordenador: Rodrigo De-Losso	Sala E2	
ID	Título	Autores	Apresentador	Debatedor
4656	Seleção de carteiras de variância mínima usando dados intradiários: uma comparação empírica entre diferentes medidas realizadas para dados da BM&Fbovespa	Bruna Kasprzak Borges, João Caldeira, Flávio Ziegelmann	Bruna Kasprzak Borges	Rodrigo De-Losso
4426	Uma Análise de Performance da Gestão Ativa em Fundos de Ações	Daniel Kendi Kanai, Ricardo Dias de Oliveira Brito	Daniel Kendi Kanai	Leandro Manzoli Trovati
4672	Quando rebalancear carteiras ótimas: o uso de gráficos de controle como instrumento de monitoramento	Leandro Manzoli Trovati	Leandro Manzoli Trovati	Bruna Kasprzak Borges

4673	Composição Dinâmica da Dívida Pública	Juliana Inhasz, Rodrigo De-Losso	Rodrigo De-Losso	Daniel Kendi Kanai
FCO-5 : Finanças Corporativas		Coordenador: Raquel de Freitas Oliveira		Sala E3
ID	Título	Autores	Apresentador	Debatedor
4486	Asymmetric transmission of a bank liquidity shock: evidence from Brazil	André B. Costa, Rafael F. Schiozer, Raquel de Freitas Oliveira	Rafael F. Schiozer	Paulo Renato Soares Terra
4489	Initial Public Offering (IPO), Mobility of Workers, and Wage Differentials: Evidence from Brazil	Thaís Salzer Procópio, Ricardo Freguglia, Fernanda Finotti C. Perobelli	Fernanda Finotti C. Perobelli	Rafael Borges Ribeiro
4497	Estrutura de Capital, Internacionalização e Países de Destino de Empresas Brasileiras: Uma Análise da Hipótese Upstream-Downstream	Rafael Borges Ribeiro, Vinícius Silva Pereira, Kárem Cristina de Sousa Ribeiro	Rafael Borges Ribeiro	Rafael F. Schiozer
4511	Financial Constraints and the Interdependence of Corporate Financial Decisions: A Cross-Country Study	Guilherme Kirch, Paulo Renato Soares Terra	Paulo Renato Soares Terra	Fernanda Finotti C. Perobelli

INV-3 & FCO-6 : Investimentos e Finanças Corporativas		Coordenador: Dante Mendes Aldrighi		Sala E4
ID	Título	Autores	Apresentador	Debatedor
4663	Concentração da Propriedade do Capital e Controle das Empresas no Brasil	Dante Mendes Aldrighi	Dante Mendes Aldrighi	Samuel Mamede
4666	Ineficiência Informacional e/ou valor da Liquidez? Estudo da Atuação dos Formadores de Mercado no Brasil	Pablo Rogers, Samuel Mamede	Samuel Mamede	Dante Mendes Aldrighi
4669	As Agências de Ratings de Risco Soberano e os Fundamentos Macroeconômicos dos Países: um Estudo Sobre as Atribuições de Risco	Jailson Conceição T. de Oliveira, Bruno Ferreira Frascaroli	Jailson Conceição T. de Oliveira	Robert Aldo Iquiapaza
4671	Desempenho de Novas Propostas de Seleção de Portfólios	Robert A. Iquiapaza, Carolina M. da Silva Roma, Gustavo R. Carvalho, Bruna S. D. Drummond	Gustavo R. Carvalho e Bruna Salerno D. Drummond	Jailson Conceição T. de Oliveira

INV-4 : Investimentos		Coordenador: Andrea M. Accioly F. Minardi		Sala E5
ID	Título	Autores	Apresentador	Debatedor
4445	Just Words? A Quantitative Analysis of the Communication of the Central Bank of Brazil	Carlos Viana de Carvalho, Fernando Cordeiro, Juliana Vargas	Carlos Viana de Carvalho	Ricardo Magalhães Sousa
4448	Indexação de Fundos de Pensão com Fundos de Índice	Maria Alcina R. Sanfins	Maria Alcina R. Sanfins	Alex Marini Aun
4450	Estimação do Prêmio por Liquidez: Aplicação para o Mercado Brasileiro	Andrea Maria Accioly F. Minardi, Alex Marini Aun	Alex Marini Aun	Carlos Viana de Carvalho
4459	Recursive Preferences, Consumption Smoothing and Risk Premium	Ricardo Magalhães Sousa, Manuel J. Rocha Armada; Mark E. Wohar	Ricardo Magalhães Sousa	Maria Alcina Rodrigues Sanfins