

Trabalhos aceitos para apresentação no XXI Encontro Brasileiro de Finanças

Área Temática	ID	Título	Autor(es)
Derivativos e Risco	181005	The Determinant Factors of Hedging and Speculation with Foreign Exchange Derivatives of Brazilian Private Firms	Fernando Nascimento de Oliveira
Derivativos e Risco	183645	Minkowski deviation measures	Marlon Ruoso Moresco, Marcelo Brutti Righi, Eduardo de Oliveira Horta
Derivativos e Risco	183883	Can a Machine Correct Option Pricing Models?	Caio Almeida, Jianqing Fan, Francesca Tang
Derivativos e Risco	184456	Currency Returns and Systematic Risk	Fernanda Mundim, Alex Ferreira, Giuliano Ferreira, Pedro Roveri
Derivativos e Risco	184710	Option Prices and Risk-Corrected Probabilities of a Binary Event	Alex Luiz Ferreira, Yujing Gong, Arie Gozluklu
Derivativos e Risco	184726	A tale of two comonotonic assets: can they provide diversification benefits?	Samuel Solgon Santos, Marcelo Brutti Righi, Eduardo de Oliveira Horta
Derivativos e Risco	185507	Brazilian Electricity Market and Weather Derivatives:Hedging Temperature Using Blockchain	Fernando Alves Silveira, Sílvio Parodi Oliveira Camilo
Derivativos e Risco	186923	Nonparametric Extreme Value Mixture Models: Applications to Insurance Losses	Alexandre Bassi, Alan De Genaro
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	180428	Dynamic Ordering Learning in Multivariate Forecasting	Bruno Levy, Hedibert F. Lopes
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	180761	Duration Dependent Volatility Models with Value-weighted Approach	Fernando Henrique de Paula e Silva Mendes, Douglas Eduardo Turatti, João Henrique G. Mazzeu, João Frois Caldeira
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	181439	Assessing nonlinearities in the price discovery process of Brazilian cross-listed stocks on NYSE and B3	Leandro Maciel
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	181467	Efeito disposição e momentum via regressão quantílica	Rodrigo Abbade da Silva, Newton Carneiro Affonso da Costa Junior
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	183484	Impacto da dependência de morte em contratos last survivor	Igor Ferreira do Nascimento
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	183720	Long Memory and Term Structure of Interest Rates	Fernanda Valente, Márcio Laurini
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	183771	Constrained Polynomial Likelihood	Caio Almeida, Paul Schneider
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	184149	THE TAIL AND THE CENTER - Truncated Lévy Flights and Hill estimator on Bitcoin	Mateus Hiro Nagata, Raul Yukihiro Matsushita
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	184293	Semiparametric Portfolio Policies	Andre Alves Portela Santos, João F. Caldeira, Hudson S. Torrent
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	184312	Arbitragem nos Mercados de Criptomoedas da América Latina	Fernando Barros Jr, Matheus Oliveira da Silva
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	184361	COVID-19 and Herding in Global Equity Markets	Alexandre Rubesam, Gerson de Souza Raimundo Júnior
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	184368	Brazilian Banking Cycle Synchronization During COVID-19 Crisis	Paulo Icaro Barros Rodrigues da Costa, Antônio Cristiano de Oliveira Costa, Paulo Rogério Faustino Matos
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	184658	Estudo da Suficiência dos Fatores no Apreçamento de Ativos	Rafaela Dezidério dos Santos Rocha, Márcio Poletti Laurini
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	185691	Forecasting with VAR-teXt and DFM-teXt models: exploiting changes in central bank communication	Leonardo Nogueira Ferreira
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	187204	Uma análise do impacto da adoção das IFRS na volatilidade do mercado brasileiro	Fernando Barros Jr, Willian Antônio de Castro, Valdemar Rodrigues de Pinho Neto
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	187240	Can sentiment of the Brazilian Central Bank help to predict yield curve?	Cássio Roberto de Andrade Alves, Kuruvilla Joseph Abraham
Econometria e Métodos Numéricos em Finanças	187296	Fitting and forecasting the yield curve: the benefits of time-varying parameters, time-varying volatility, and arbitrage restrictions	Werley da Costa Cordeiro, João Frois Caldeira, André Alves Portela Santos
Finanças Corporativas	182378	Governing Innovation: The Role of Board of Directions' Human and Social Capital	Mirian Wawrzyniak Chimirri, Luiz Ricardo Kabbach de Castro

Finanças Corporativas	182871	The effects of financial constraints on the market value of cash in a mandatory dividend context	Aviner Augusto Silva Manoel, Marcelo Botelho da Costa Moraes, Juliano Augusto Orsi Araujo
Finanças Corporativas	182872	The impact of the degree of internationalization on cash levels: evidence from Latin America	Aviner Augusto Silva Manoel, Marcelo Botelho da Costa Moraes
Finanças Corporativas	182874	The Effects of the Degree of Internationalization on the Market Value of Cash: Evidence from Latin America	Aviner Augusto Silva Manoel, Marcelo Botelho da Costa Moraes
Finanças Corporativas	183823	Do Board Interlock and Gender Diversity affect CEO compensation? Evidence from Brazilian listed companies	Claudine Pereira Salgado, Cristiano Machado Costa, Guilherme Mayer Schneider
Finanças Corporativas	184031	Gestão do capital de giro e rentabilidade: estudo sobre o ponto ótimo de investimento nas empresas brasileiras	Tiago César Farinelli, Marcelo Augusto Ambrozini
Finanças Corporativas	184049	COVID-19, Policy Interventions and Credit: The Brazilian Experience	Lars Norden, Daniel Mesquita, Weichao Wang
Finanças Corporativas	184052	Is a Friend in Need a Friend Indeed? How Relationship Borrowers Fare during the COVID-19 Crisis	Allen N. Berger, Christa H.S. Bouwman, Lars Norden, Raluca Roman, Gregory F. Udell
Finanças Corporativas	184053	"Less is More": Credit Default Swaps and Firm Cyclicity	Lars Norden, Chao Yin, Lei Zhao
Finanças Corporativas	184164	Can remote voting mitigate agency problems?	Igor Bernardi Souza, Letícia Marasca
Finanças Corporativas	184443	Stock Price Crash Risk and the adoption of Poison Pills: Evidence from Brazil	Yuri Gomes Paiva Azevedo, Lucas Allan Diniz Schwarz, Hellen Bomfim Gomes, Marcelo Augusto Ambrozini
Finanças Corporativas	184468	MÁ CONDUTA GERENCIAL: A RESPOSTA DO MERCADO DIANTE DE ESCÂNDALOS CORPORATIVOS	Igor Bernardi Souza, Alison Geovani Schwingel Franck, Letícia Moraes Silveira, Lillian Cristiane Ribeiro Steffler
Finanças Corporativas	184505	Competition and ESG practices in emerging markets: evidence from a differences-in-differences model	Henrique Castro Martins
Finanças Corporativas	184517	Decodificando o Puzzle da relação ESG-Performance Financeira: Uma Revisão Sistemática de Literatura	Rafael Ukazono Kubiski, Ana Julia Akaishi Padula
Finanças Corporativas	184609	Investimentos operacionais em P&D como estratégia para desempenho diferenciado	Henrique Suathê Esteves, José Francisco Moreira Pessanha, Ricardo Lopes Cardoso, Renata Kaori Tani Viana
Finanças Corporativas	184656	Acquisitions under financing frictions: evidence from credit supply shortfalls	Lucas Serrão Macoris, Luiz Ricardo Kabbach de Castro
Finanças Corporativas	184765	Efeitos da eficiência jurídica no custo do crédito das micro e pequenas empresas no Brasil: Uma análise a partir do poder de mercado dos bancos	Tyago Oliveira do Carmo, Gervásio Ferreira Santos
Finanças Corporativas	185492	Housing Collateral Reform and Economic Reallocation	Dimas Mateus Fazio, Thiago Silva
Finanças Corporativas	187083	ASSOCIAÇÃO ENTRE O DISCURSO RELEVANTE E O PREÇO DOS ATIVOS: Com processamento de linguagem natural	Admir Renan Voltolini Gomes, Samuel Lyncon Leandro de Lima, Nelson Hein
Finanças Corporativas	187087	State-owned enterprises' stock returns and risk exposures in Brazil	Lucas Nogueira Cabral de Vasconcelos, Carolina Coletta
Finanças Corporativas	187300	Corporate Governance and Bond Yields: Evidence from Brazil	Romain Cailleau, Antônio Artur de Souza
Finanças Corporativas	187303	DOES CORPORATE CLIMATE PERFORMANCE AFFECT CORPORATE FINANCIAL PERFORMANCE? A CROSS-REGION ANALYSIS ON RETURN, VALUE, AND LIQUIDITY	Rebeca Peres de Lima, Jéfferson Augusto Colombo
Investimentos	180645	Who is saving and how much? New evidence from Brazil	Luan Vinicius Bernardelli, Wander Plassa, Pietro Andre Telatin Paschoalino
Investimentos	181842	Unskilled fund managers: replicating active fund performance with few ETFs	Fernando Tassinari Moraes, Elias Cavalcante Filho, Rodrigo De Losso
Investimentos	182744	Macro Announcement Disagreement Observed in the Cross Section of Stocks	Leonardo Salim Saker Chaves
Investimentos	183065	Finding the risk-return trade-off with Google	Pedro Piccoli
Investimentos	184260	Determinantes da Velocidade de Chamada e Devolução de Capital em Fundos de Private Equity Brasileiros	João Vitor Aparecido dos Santos, Andrea Maria Accioly Fonseca Minardi
Investimentos	184291	Can Machine Learning Help to Select Portfolios of Mutual Funds?	Andre Alves Portela Santos, Victor DeMiguel, Javier Gil-Bazo, Francisco J. Nogales
Investimentos	184449	The diversification benefits of cryptocurrencies in multi-asset portfolios: cross-country evidence	Jéfferson Augusto Colombo, Fernando Ioannides Lopes da Cruz, Luis Henrique Zanandrea Paese, Renan Xavier Cortes
Investimentos	184620	Gender gap and regional economic diversity in microfinance: evidence from the microcredit program of the State of Bahia	Diego Nunes Teixeira, Tyago Oliveira do Carmo, Gervásio Ferreira dos Santos
Investimentos	184745	Does the ESG investment strategy generate alpha? Evidence from Brazilian stock market	Victor Henriques, Claudia Emiko Yoshinaga, William Eid Júnior
Investimentos	184762	Daily, unambiguous, heterogeneous mutual fund flows and their performance sensitivity	Andre Lot

Investimentos	187260	<u>Investor sentiment and equity mutual fund performance</u>	Sabrina Espinele da Silva, Simone Evangelista Fonseca, Carolina Magda da Silva Roma, Robert Aldo Iquiapaza, Seung Hun Han
Investimentos	187288	<u>Atenção do Investidor Brasileiro em Tempos Bons e Ruins do Mercado de Ações: Efeito Avestruz ou Suricato?</u>	Marcelo Guzella, Laura Dalcin
Investimentos	187302	<u>False Discoveries and Luck in the Brazilian Equity Fund Market</u>	Alan de Genaro, Henrique Lamounier Costa, Victor Henriques