

Coleção Coppead de Administração

Newton Carneiro Affonso da Costa Jr.

Ricardo Pereira Câmara Leal

Eduardo Facó Lemgruber

Organizadores

# MERCADO DE CAPITAIS



## Análise Empírica no Brasil

Colaboradores

Alexandre Mescolin

Antonio José Varanda

Boris Asrilhant

Eduardo Facó Lemgruber

Emílio A. Menezes

Francisco de Resende Baima

João Luiz Becker

John O'Hanlon

José Lucenildo Parente Pimentel

Marcelo B. Picango

Myrian B. Eiras das Neves

Newton C. A. da Costa

Newton C. A. da Costa Jr.

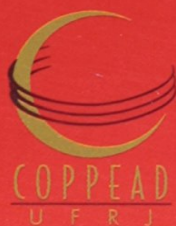
Paulo Sergio Ceretta

Patrícia Barros Ramos

Ricardo B. Rêgo

Ricardo P. C. Leal

Tânia B. S. Chaves



# Resumo de Mercado de Capitais. Análise Empírica no Brasil

Os textos contidos neste livro foram cuidadosamente selecionados por três dos mais profundos e produtivos professores de Finanças, que aliam sólidos conhecimentos teóricos com a experiência prática como consultores. Os tópicos abrangem temas em evidência na literatura internacional e enfatizam a parte empírica de finanças.

Os 14 capítulos estão organizados em três partes: administração de carteiras, modelos de preços e anomalias e eficiência. São os seguintes: (1) Quantas ações tornam um portfólio diversificado no mercado de capitais brasileiro?; (2) Avaliação de desempenho dos investimentos dos fundos de pensão; (3) Impacto do Anexo IV no mercado de capitais brasileiro; (4) Avaliação e seleção de fundos de investimento; (5) Estimação do beta de ações através do método dos coeficientes agregados; (6) Variáveis fundamentalistas e retorno das ações; (7) Integração entre as bolsas de valores de Buenos Aires e São Paulo; (8) Retornos e riscos das value e growth stocks no mercado brasileiro; (9) O efeito de fim de semana no comportamento dos retornos diários de índices de ações; (10) O efeito tamanho versus o efeito mês-do-ano no mercado de capitais brasileiro; (11) Teoria do caos e mercado financeiro; (12) Sobre-reação a longo prazo no mercado brasileiro de ações; (13) Desempenho de estratégias grafistas de interseção de médias móveis através de simulação bootstrap; (14) Market timing no Brasil.

[Acesse aqui a versão completa deste livro](#)