



## **Bibliografia Sugerida**

**Exame CGE**

**Data: 01/06/2021**

## 1. INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS

### a) LIVROS

BORTONE JUNIOR, R.M. **Transações imobiliárias**. Editora Érica, 2018.

MENDES, R.A. **Fundos de Investimento Imobiliário: Aspectos Gerais e Princípios de Análise**. Editora Novatec, 2018.

### b) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

AMATO, F.B. **Impacto da Taxa de Juros Reais no Brasil no Valor dos Imóveis para Renda: o caso dos Fundos de Investimento Imobiliário negociados em Bolsa de Valores**. Latin American Real Estate Society (LARES), 2007.

CASTRO, M.A.F. **Co-integração na indústria de fundos imobiliários no Brasil**. Tese-UFC, 2012.

SCOLESE, D.; BERGAMNN, D.R.; DA SILVA F.L.; SAVOIA, J.R.F. Análise de estilo de fundos imobiliários no Brasil. **Revista de Contabilidade e Organizações**, v. 23, p. 24-35., 2015.

### c) LINKS ÚTEIS

MATERIAIS da B3. **B3**. Disponíveis em: [http://www.b3.com.br/pt\\_br/produtos-e-servicos/negociacao/renda-variavel/fundos-de-investimento-imobiliario-fii.htm](http://www.b3.com.br/pt_br/produtos-e-servicos/negociacao/renda-variavel/fundos-de-investimento-imobiliario-fii.htm)

## 2. PRIVATE EQUITY

### a) LIVROS

CENDROWSKI, H.; MARTIN, J.P.; PETRO, L.W. **Private Equity: History, Governance, and Operations**. 2. ed. Editora John Wiley & Sons, (2012).

LOVE, H. **The Start-Up J Curve**. 1. ed. Greenleaf Book Group Press, 2016.

### b) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

CARVALHO, A.G.; GALLUCCI NETTO, H.; SAMPAIO, J. Private Equity e Venture Capital no Brasil: uma Análise de sua Evolução. **Brazilian Review of Finance, Brazilian Society of Finance**, v. 12, n. 4, p. 499-515, 2014.

### 3. SECURITIZAÇÃO DE RECEBÍVEIS

#### a) LIVROS

BAIG, S.; CHOUDHRY, M. **The Mechanics of Securitization**. 1. ed. Editora Willey, 2013.

PIRES, Daniela. **Os Fundos de Investimento em Direitos Creditórios (FIDC)**. 2. ed. Editora Almedina, 2015.

#### b) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

BENEA, I.; DUMA, F. Financing with Receivables: Factoring, Securitization and Collateral. Finance – Challenges of the Future, **University of Craiova, Faculty of Economics and Business Administration**, 1(15), p. 79-86, 2013

BUCHANAN, B. G. Securitization: A financing vehicle for all seasons? **Journal of Business Ethics**, v. 138, p. 559-577, 2016

BUDINGER, V. Analyzing Brazilian ABS: FIDCs. **The Journal of Structured Finance**, 18(1), p. 100-122, 2012

CATÃO, G.C.; RODRIGUES, R.N.; LIBONATI, J.J.; LAGIOIA, U.C.T. Securitization in the Brazilian Banking Industry: An Empirical Study. **Brazilian Review of Finance**, v. 7, n. 3, 327-345, 2009

GOBETI, B.C. **SECURITIZAÇÃO DE DIREITOS CREDITÓRIOS NÃO PERFORMADOS NOS FUNDOS DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS – FIDC**. 2016. Monografia LLM, Insper.

MARIANI, V.F.L. **A ESTRUTURA DA SECURITIZAÇÃO DE RECEBÍVEIS NO BRASIL E A FORMAÇÃO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS (FIDC)**. 2014. Monografia, UFPR.

#### c) LINKS ÚTEIS

PRODUTOS Especiais de Captação: Fundos de Investimento em Direitos Creditórios. **ANBIMA**. Disponível em:

[https://www.anbima.com.br/data/files/89/A0/02/F5/EDB675106582A275862C16A8/FIDC\\_1\\_.pdf](https://www.anbima.com.br/data/files/89/A0/02/F5/EDB675106582A275862C16A8/FIDC_1_.pdf)

Retenção de Risco na Securitização: um estudo a partir da metodologia de análise de impacto regulatório. Trabalhos para Discussão. **Comissão de Valores Mobiliários**, 2014. Disponível em:

[http://conteudo.cvm.gov.br/export/sites/cvm/menu/acesso\\_informacao/serieshistoricas/estudos/anexos/AIR\\_retencao-de-riscos.pdf](http://conteudo.cvm.gov.br/export/sites/cvm/menu/acesso_informacao/serieshistoricas/estudos/anexos/AIR_retencao-de-riscos.pdf)

#### 4. FUNDOS DE ÍNDICE

##### a) LIVROS

FREITAS, B.V. **Fundos de Investimento. Aspectos Jurídicos, Regulamentares e Tributários**. 1. ed. Editora Quartier Latin, 2015.

SCHNEIDER, D. **Index Funds & Etf's: What They Are and How to Make Them Work for You**. 1. ed. Editora Createspace Independent Publishing Platform, 2017.

##### b) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

IQUIAPAZA, R.A.; VIDAL, F.; AMARAL, H.F.; BRESSAM, A.A. Condicionantes do crescimento dos fundos mútuos de renda fixa no Brasil. **RAUSP**, v. 43, n. 3, 2008.

LEUSIN, L.M.C; BRITO, R.D. Market timing e avaliação de desempenho dos fundos brasileiros. **Revista de Administração de Empresas (RAE)**, v. 48, n. 2, 2008.

MAESTRI, C.O.N.M.; MALAQUIAS, R.F. Exposition to Factors of the Investment Funds Market in Brazil. **Revista de Contabilidade e Finanças - USP**, v. 48, n. 73, p. 61-76, 2016.

ROCHA, M.D. **Análise de desempenho de fundos de renda fixa no Brasil por meio da Análise Envoltória de Dados (DEA)**. 2014. Dissertação – UnB

##### c) LINKS ÚTEIS

Fundos de índice - ETFs. **Portal do Investidor**. Disponível em:

[https://www.investidor.gov.br/menu/Menu\\_Investidor/valores\\_mobiliarios/ETFs.html#:~:text=Os%20fundos%20de%20C3%ADndice%2C%20ou,de%20a%20C3%A7%20B5es%20reconhecido%20pela%20CVM](https://www.investidor.gov.br/menu/Menu_Investidor/valores_mobiliarios/ETFs.html#:~:text=Os%20fundos%20de%20C3%ADndice%2C%20ou,de%20a%20C3%A7%20B5es%20reconhecido%20pela%20CVM)

#### 5. INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

##### a) LIVROS

ABNER, D.J. **The ETF Handbook: How to Value and Trade Exchange-Traded Funds**. Editora Wiley, 2011.

CULP, C.L. **Structured Finance and Insurance: The ART of Managing Capital and Risk**. Wiley, 2006.

FABOZZI, F.J.; CHOUDHRY, M.; DAVIS, H.A. **Introduction to Structured Finance**. Editora Wiley, 2006.

LARREUR, C. **Structured Finance: Leveraged Buyouts, Project Finance, Asset Finance and Securitization**. Editora Wiley, 2021.

WEINER, S.M. **The Complete Guide to ETF Portfolio Management: The Essential Toolkit for Practitioners**. Editora Mc Graw Hill, 2021.

b) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

BHATTACHARYA, A.; O'HARA, M. ETFs and Systemic Risks. **CFA Institute**, 2020.

## 6. AVALIAÇÃO DE DESEMPENHO

a) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

CLARE, A. Performance Evaluation. **CFA Institute**

FERSON, W.E. Investment Performance Evaluation. **Annual Review of Financial Economics**. v. 2, p. 207-234, 2010.

LEHMANN, B.N.; MODEST, D.M. Mutual Fund Performance Evaluation: A Comparison of Benchmarks and Benchmark Comparisons. **The Journal of Finance**, v. 42, n. 2, p. 233-265, 1987.

MOURA, L.B. AVALIAÇÃO DE DESEMPENHO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO, RELATIVO A SEU PATRIMÔNIO LÍQUIDO. **UFRJ**, 2015.

## 7. GESTÃO DE RISCO

a) LIVROS

CROUHY, M. **The Essentials of Risk Management**. McGraw Hill, 2014.

DAMODARAN, A. **Gestão estratégica do risco**. Editora Bookman, 2009.

LIMA, F.G. **Análise de riscos**. 2. ed. Editora Atlas, 2018.

OLIVEIRS, V.I.; PINHEIRO, J.L. **Gestão de riscos no mercado financeiro**. Editora Saraiva, 2018.

b) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

BRUNNERMEIER, M.K.; YOGO, M. A Note on Liquidity Risk Management. **American Economic Review**, v. 9, n. 2, p. 578-583, 2009.

KELLY, B.; JIANG, H. Tail Risk and Asset Prices. **The Review of Financial Studies**, v. 27, n. 10, p. 2841–2871, 2014.

KOJIMA, J.C.; MURPHY, D.J. Hitting the Curve Ball: Risk Management in Private Equity. **The Journal of Private Equity**, v. 14, n. 2, p. 18-42, 2011.

## **8. LEGISLAÇÃO, REGULAÇÃO E TRIBUTAÇÃO**

### a) INSTRUÇÕES CVM

**ICVM 472/08**

**ICVM 578/16**

**ICVM 356/01**

**ICVM 359/02**

### b) LEIS

**Lei 8.668/93**

**Lei 9.779/99**

**Lei 11.033/04**

**Lei 11.196/05**

**Lei 11.478/07**