



Bibliografia Sugerida

Exame CFG

Data: 01/06/2021

1. MÉTODOS QUANTITATIVOS

a) LIVROS

ANDERSON, D.R.; SWEENEY, D.J.; WILLIAMS, T.A.; CAMM, J.D.; COCHRAN, J.J. **Estatística Aplicada à Administração e Economia**. 8. ed. Editora Cengage Learning, 2019.

CVM, BM&F Bovespa. **Análise de investimentos**. Coleção TOP, 2017.

GUJARATI, D.N. **Econometria básica**. 5. ed. Editora AMGH, 2011.

LEMOS, F.A.C.A. **Análise técnica dos mercados financeiros**. 2. ed. Editora Saraiva, 2018.

MORETTIN, P.A.; BUSSAB, W.O; **Estatística básica**. 9. ed. Editora Saraiva, 2017.

WOOLDRIDGE, J.M. **Introdução à econometria. Uma abordagem moderna**. 3. ed. Editora Cengage Learning, 2017.

2. ECONOMIA

a) LIVROS

MANKIW, N. G. **Macroeconomia**. 10. ed. Editora Atlas, 2021.

PINDYCK, R. S.; RUBINFELD, D. L.; **Microeconomia**. 8. ed. Editora Pearson Universidades.

VARIAN, H.H. **Microeconomia - Uma Abordagem Moderna**. 9. ed. Editora Gen Atlas, 2015.

b) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

BARBOSA, F.H. Política monetária: instrumentos, objetivos e a experiência brasileira. **FGV EPGE**.

c) LINKS ÚTEIS

CFG. **ANBIMA**. Disponível em: https://www.anbima.com.br/pt_br/educar/certificacoes/cfg.htm

ESTATÍSTICAS fiscais e planejamento. **Tesouro Nacional**. Disponível em:
<https://www.gov.br/tesouronacional/pt-br/estatisticas-fiscais-e-planejamento>

ÍNDICES de Preços. **Banco Central do Brasil**. Disponível em:
<https://www.bcb.gov.br/controleinflacao/indicepreco>

INFLAÇÃO. **IBGE**. Disponível em: <https://www.ibge.gov.br/explica/inflacao.php>

MECANISMOS de transmissão da política monetária. **Banco Central do Brasil**. Disponível:
<https://www.bcb.gov.br/controleinflacao/transmissaopoliticamonetaria>

PIB. **IBGE**. Disponível em: <https://www.ibge.gov.br/explica/pib.php>

POLÍTICA monetária. **Banco Central do Brasil**. Disponível em: <https://www.bcb.gov.br/controleinflacao>

PORTAL da Inflação. **IBRE**. Disponível: <https://portal-da-inflacao-ibre.fgv.br/>

SISTEMA Financeiro Nacional. **Banco Central do Brasil**. Disponível em:
<https://www.bcb.gov.br/estabilidadefinanceira/sfn>

3. ANÁLISE DE RELATÓRIOS FINANCEIROS

a) LIVROS

ASSAF NETO, A; **Estruturas e Análise de Balanços - Um Enfoque Econômico-financeiro**. Editora Atlas, 2020.

Málaga, F.K. **Análise de Demonstrativos Financeiros e da Performance Empresarial: Para Empresas Não Financeiras**. 3. ed. Editora Saint Paul, 2014.

ROSS, S.A.; WESTERFIELD, R.W.; JAFFE, J. **Administração financeira**. Mc Graw Hill, 2015.

b) PROCUNCIAMENTOS CONTÁBEIS

CPC 26

4. FINANÇAS CORPORATIVAS

a) LIVROS

ASSAF NETO, A. **Finanças corporativas e valor**. 8. ed. Editora Atlas, 2020.

BREALEY, R.; MYERS, S.; ALLEN, F. et. al. **Princípios de Finanças Corporativas**. 12. ed. Mc Graw Hill, 2018.

ROSS, S.A.; WESTERFIELD, R.W.; JAFFE, J. **Administração financeira**. Mc Graw Hill, 2015.

b) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

BHAGAT, S.; BOLTON, B. Corporate governance and firm performance. **Journal of Corporate Finance**, v. 14, n. 3, p. 257-273, 2008.

Shleifer, A., Vishny, R.W. A survey of corporate governance. **The Journal of Finance**, v. 52, n. 2, p. 737-783, 2012.

c) LINK ÚTEIS

CÓDIGO das melhores práticas de governança corporativa. **IBGC**. Disponível em:
<https://conhecimento.ibgc.org.br/Paginas/Publicacao.aspx?PubId=21138>

GOVERNANÇA Corporativa. **IBGC**. Disponível em: <https://www.ibgc.org.br/conhecimento/governanca-corporativa>

PRINCIPLES of Corporate Governance. **Harvard Law School**. Disponível em:
<https://corpgov.law.harvard.edu/2016/09/08/principles-of-corporate-governance/>

5. MERCADOS E INSTRUMENTOS FINANCEIROS

a) LIVROS

ASSAF Neto, A. **Mercado financeiro**. Editora Atlas, 2018.

CVM; BM&F Bovespa. **Mercado de derivativos no Brasil: conceitos, produtos e operações**. Coleção TOP CVM, 2015.

FABOZZI, F.J.; MANN, S.V. **The Handbook of Fixed Income Securities**. 8. ed. Editora McGraw Hill, 2011.

FORTUNA, E. **Mercado Financeiro – Produtos e Serviços**. 22. ed. Editora Quality Mark, 2020.

HULL, J.C.; MACEDO, COSTA, G.R.M.F.A. **Opções, Futuros e Outros Derivativos**. 9. ed. Editora Bookman, 2016.

VARANDA NETO, J.M.; SANTOS, J.C.S. **O Mercado de Renda Fixa no Brasil: Conceitos, Precificação e Risco**. 1. ed. Editora Saint Paul, 2019.

b) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

ANBIMA. Ofertas Públicas de Distribuição e Aquisição de Valores Mobiliários. **Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas**, 2013.

c) LINKS ÚTEIS

GUIA CRI. **ANBIMA**. Disponível em:

https://www.anbima.com.br/data/files/BB/C0/CB/48/2EB675106582A275862C16A8/GuiaCRI-05-Nov_1_.pdf

MARKET data e Índices. **B3**. Disponível em: http://www.b3.com.br/pt_br/market-data-e-indices/

OFERTA pública de distribuição primária e secundária. **Portal do Investidor**. Disponível em:

https://www.investidor.gov.br/menu/Menu_Investidor/ofertas/ofertas_publicas.html

SEGMENTOS de listagem. **B3**. Disponível em: http://www.b3.com.br/pt_br/produtos-e-servicos/solucoes-para-emissores/segmentos-de-listagem/sobre-segmentos-de-listagem/

STOCK Market Index. **Corporate Finance Institute**. Disponível em:

<https://corporatefinanceinstitute.com/resources/knowledge/trading-investing/stock-market-index/>

6. TEORIA MODERNA DE CARTEIRAS E MODELOS DE PRECIFICAÇÃO DE ATIVOS

a) LIVROS

ASAAF NETO, A. **Valuation - Métricas de Valor e Avaliação de Empresas**. Editora Atlas, 2019.

BODIE, Z.; KANE A.; MARCUS, A. et. al. **Investimentos**. Mc Graw Hill, 2014.

DAMODARAN, A. **Valuation - Como Avaliar Empresas e Escolher as Melhores Ações**. Editora LTC, 2012.

MARKOWITZ, Harry M. **Portfolio selection: efficient diversification of investments**. 2. ed. Cambridge: Blackwell, 1991.

POVOA, A. **Valuation - Como Precificar Ações**. 2. ed. Editora Atlas, 2019.

b) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

FABOZZI, F.J.; GUPTA, F.; MARKOWITX, H.M. The legacy of modern portfolio theory. **The Journal of Investing**, v. 11, n. 3, p. 7-22, 2002.

MARKOWITZ, Harry M. Portfolio selection. **Journal of Finance**, v. 7, p. 77-91, Mar.1952.

7. FINANÇAS COMPORTAMENTAIS

a) LIVROS

Anger, E. **A Course in Behavioral Economics**. 3. ed. Editora Red Globe Press, 2020.

Bruce, B. **Handbook of behavioral finance**. Edward Elgar Publishing, 2012.

KAHNEMAN, Daniel. **Rápido e devagar: duas formas de pensar**. Editora Objetiva, 2012.

MONTIER, J. **The Little Book of Behavioral Investing: How not to be your own worst enemy**. 1. ed. Editora Wiley, 2010.

b) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

BARBERIS, N.; THALER, R. A SURVEY OF BEHAVIORAL FINANCE. **NATIONAL BUREAU OF ECONOMIC RESEARCH**, n. 9222, 2002

KAHNEMAN, Daniel; TVERSKY, Amos. Prospect theory: An analysis of decision under risk, *Econometrica*. **Journal of the econometric Society**, p. 263-291, 1979.

KAHNEMAN, Daniel; TVERSKY, Amos. Subjective probability: A judgment of representativeness. **Cognitive psychology** 3, n. 3, p. 430-454, 1972.

KAHNEMAN, Daniel. Maps of bounded rationality: psychology for behavioral economics. **American Economic Review**, v. 93, n. 5, p. 1449-75, dez. 2003.

Kimura, H., Basso, L.F.C., Krauter, E. PARADOXOS EM FINANÇAS: TEORIA MODERNA VERSUS FINANÇAS COMPORTAMENTAIS. **RAE**, v. 46, n. 1, p. 41-58, 2006.

TVERSKY, Amos; KAHNEMAN Daniel. Belief in the law of small numbers. **Psychological bulletin** 76, n. 2, p. 105, 1971.

KAHNEMAN, Daniel; TVERSKY, Amos. Judgment under uncertainty: Heuristics and biases. **Springer. P.** p. 141-162, 1975.

a) LINKS ÚTEIS

Economia Comportamental. Disponível em: <http://www.economiacomportamental.org/>

Série CVM Comportamental. **CVM**. Disponível em:
<https://www.investidor.gov.br/publicacao/ListaCVMComportamental.html>

8. POLÍTICA DE INVESTIMENTO (INVESTMENT POLICY STATEMENT – IPS)

a) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

CFA INSTITUTE. ELEMENTS OF AN INVESTMENT POLICY STATEMENT FOR INDIVIDUAL INVESTORS. **CFA Institute**, 2010.

CFA INSTITUTE. ELEMENTS OF AN INVESTMENT POLICY STATEMENT FOR INSTITUTIONAL INVESTORS. **CFA Institute**, 2010.

VANGUARD. Sample Investment Policy Statement. **Vanguard**, 2019.

9. ALOCAÇÃO DE ATIVOS

a) LIVROS

GIBSON, R. **Asset Allocation: Balancing Financial Risk**. 5. ed. Editora McGraw Hill, 2013.

MARSTON, R. **Portfolio Design: A Modern Approach to Asset Allocation (a review)**. 1. ed. Editora Wiley, 2011.

b) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

MARSTON, R. **Portfolio Design: A Modern Approach to Asset Allocation (a review)**. **CFA Institute**, 2011.

10. NOVAS TECNOLOGIAS EM FINANÇAS

a) LIVROS

ARSLANIAN, H. **The Future of Finance: The Impact of FinTech, AI, and Crypto on Financial Services**. Editora Springer, 2019.

GUPTA, **Manav**. **Blockchain For Dummies**. 3. ed. IBM Limited Edition. Editora John Wiley & Sons, 2020.

LEWIS, A. **The Basics of Bitcoins and Blockchains: An Introduction to Cryptocurrencies and the Technology that Powers Them**. Editora Mango Media, 2018.

SIRONI, P. **FinTech Innovation: From Robo-Advisors to Goal Based Investing and Gamification**. Editora Wiley, 2016.

b) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

ARNER, D; AUER, R.; FROST, J. Stablecoins: risks, potential and regulation. **BIS Working Papers**, n. 905, 2020.

CORNELLI, G.; DOERR, S.; GAMBACORTA, L.; MERROUCHE, O. Inside the Regulatory Sandbox: Effects on Fintech Funding. **BIS Working Papers**, n. 901, 2020.

MICHAEL, B. The FinTech Dividend? How Much Money Is FinTech Likely to Mobilize for Sustainable Development? **CFA Institute**, 2020.

HOUGAN, M.; LAWANT, D. Cryptoassets: The Guide to Bitcoin, Blockchain, and Cryptocurrency for Investment Professionals. **CFA Institute**, 2021.

RESTOY, F. Fintech regulation: how to achieve a level playing field. **BIS Occasional Paper n. 17**, 2021.

c) LINKS ÚTEIS

BLOCKCHAIN e Criptoemoedas Report 2020. **Distrito**. Disponível em:
<https://conteudo.distrito.me/dataminer-blockchain>

CRYPTOASSETS: The Guide to Bitcoin, Blockchain, and Cryptocurrency for Investment Professionals. CFA Institute. Disponível em: <https://www.cfainstitute.org/en/research/foundation/2021/cryptoassets>

FINANCIAL applications of distributed ledger technology. **CFA Analyst Notes**. Disponível em:
<https://analystnotes.com/cfa-study-notes-financial-applications-of-distributed-ledger-technology.html>

FINTECH Report 2020. **Distrito**. Disponível em: <https://conteudo.distrito.me/dataminer-fintech>

OPEN Banking. **Banco Central do Brasil**. Disponível em:
<https://www.bcb.gov.br/estabilidadefinanceira/openbanking>

RADAR Fintechlab 2020. **Fintechlab**. Disponível em:
<https://fintechlab.com.br/index.php/2020/08/25/edicao-2020-do-radar-fintechlab-detecta-270-novas-fintechs-em-um-ano/>

SANDBOX regulatório. **Banco Central do Brasil**. Disponível em:
<https://www.bcb.gov.br/estabilidadefinanceira/sandbox>

SANDBOX regulatório. **CVM**. Disponível em:
http://conteudo.cvm.gov.br/legislacao/sandbox_regulatorio.html

11. ÉTICA E AUTORREGULAÇÃO

a) LIVROS

PECK, S. **Investment Ethics**. Editora Wiley, 2010.

SILVEIRA, A.M. **Ética empresarial na prática: soluções para gestão e governança no século XXI**. Editora Alta Books, 2017.

b) ARTIGOS, TESES, DISSERTAÇÕES

CFA INSTITUTE. Ethics and the Investment Industry. **Standards of Practice Guidance**, 2017.

O'ROURKE, A. The message and methods of ethical investment. **Journal of Cleaner Production**, v.11, n. 6, p. 683-693, 2003.

c) LINKS ÚTEIS

CÓDIGOS ANBIMA. **ANBIMA**. Disponível em:

https://www.anbima.com.br/pt_br/autorregular/codigos/entenda.htm

12. LEGISLAÇÃO E REGULAÇÃO

a) LIVROS

CVM. **Direito do mercado de valores mobiliários**. Coleção TOP, 2017.

b) INSTRUÇÕES CVM

Instrução CVM 558

Instrução CVM 400

Instrução CVM 539

Instrução CVM 555

Instrução CVM 476

Instrução CVM 617/20

c) LEIS E RESOLUÇÕES

Lei n. 6385

Resolução CMN 4661/18

Resolução CMN 3922/10

Resolução CMN 2451/97

Resolução CNSP 321/15

Resolução CNSP 348/17

Resolução CNSP 349/17

Resolução CNSP 4444/15

Código Civil - Lei 10406/02

Lei 13874/2019

Lei 9613/98

c) LINK ÚTEIS

GUIA PLDFT. **ANBIMA**. Disponível em:

<https://www.anbima.com.br/data/files/4D/B4/AE/77/739F471017664F476B2BA2A8/Guia-ANBIMA-PLDFT.pdf>