



SERVIÇO PÚBLICO FEDERAL
MINISTÉRIO DA EDUCAÇÃO
UNIVERSIDADE FEDERAL DE UBERLÂNDIA
FACULDADE DE GESTÃO E NEGÓCIOS



CONCURSO PARA PROFESSOR EFETIVO ÁREA DE FINANÇAS

PROGRAMA E BIBLIOGRAFIA – EDITAL 096/2011

PROGRAMA PROVA ESCRITA:

1. Hipóteses dos Mercados Eficientes;
2. Teoria de Carteiras;
3. Modelo de Precificação de Ativos de Capital (CAPM);
4. Custo de Capital;
5. Avaliação de Investimentos: Orçamento de Capital e Ativos Financeiros;
6. Governança Corporativa;
7. Estrutura de Capital.

PROGRAMA PROVA DIDÁTICA:

1. Modelos de Regressão Linear: Métodos dos Mínimos Quadrados;
2. Problemas Econométricos no Modelo de Regressão Linear;
3. Modelos de Regressão com Variáveis Dependentes Binárias;
4. Modelos de Séries Temporais.

BIBLIOGRAFIA:

1. ALEXANDER, C. **Modelos de mercado: um guia para a análise de informações financeiras**. São Paulo: Bolsa de Mercadorias & Futuros, 2005.
2. ANDRADE, A.; ROSSETTI, J. P. **Governança corporativa: fundamentos, desenvolvimento e tendências**. 5ª Ed. São Paulo: Atlas, 2011.
3. BUENO, R. L. S. **Econometria de séries temporais**. 2ª Ed. São Paulo: Cengage Learning, 2011.
4. ELTON, E. J.; GRUBER, M. J.; BROWN, S. J.; GOETZMANN, W. N. **Moderna teoria de carteiras e análise de investimentos**. São Paulo: Atlas, 2004.
5. GRINBLATT, M.; TITMAN, S. **Mercados financeiros e estratégia corporativa**. 2ª Ed. Porto Alegre: Bookman, 2005.
6. GUJARATI, D. **Econometria básica**. Tradução da 4ª Ed. Rio de Janeiro: Elsevier, 2006.
7. MORETTIN, P. A.; TOLOI, C. M. C. **Análise de series temporais**. São Paulo: Edgard Blücher, 2004.
8. REILLY, F. K.; NORTON, E. A. **Investimentos**. Tradução da 7ª Ed. São Paulo: Cengage Learning, 2008.
9. WOOLDRIDGE, J. M. **Introdução à econometria: uma abordagem moderna**. Tradução da 4ª Ed. São Paulo: Cengage Learning, 2010.