



MINISTÉRIO DA EDUCAÇÃO
UNIVERSIDADE FEDERAL RURAL DE PERNAMBUCO
SECRETARIA GERAL DOS CONSELHOS DA ADMINISTRAÇÃO SUPERIOR
CONSELHO DE ENSINO, PESQUISA E EXTENSÃO

RESOLUÇÃO Nº 146/2018.

EMENTA: Aprova Projeto de Pesquisa intitulado: “A TRANSMISSÃO DE VOLATILIDADE INTRADIÁRIA DE CONTRATOS DO MERCADO FUTURO SOBRE AÇÕES DO MERCADO Á VISTA: UM ESTUDO DE CAUSALIDADE UTILIZANDO DADOS DE SERIES TEMPORAIS”, sob a responsabilidade da Unidade Acadêmica de Serra Talhada desta Universidade.

A Presidente do Conselho de Ensino, Pesquisa e Extensão da Universidade Federal Rural de Pernambuco, no uso de suas atribuições e tendo em vista o disposto no Parágrafo 6º do artigo 15 do Estatuto da Universidade e considerando os termos da Decisão Nº 088/2018 da Câmara de Pesquisa e Pós-Graduação deste Conselho, em sua II Reunião Ordinária, realizada no dia 11 de junho de 2018, exarada no Processo UFRPE Nº 23082.018574/2017-23,

R E S O L V E:

Art. 1º - Aprovar, em sua área de competência, o Projeto de Pesquisa intitulado: “A TRANSMISSÃO DE VOLATILIDADE INTRADIÁRIA DE CONTRATOS DO MERCADO FUTURO SOBRE AÇÕES DO MERCADO Á VISTA: UM ESTUDO DE CAUSALIDADE UTILIZANDO DADOS DE SERIES TEMPORAIS”, sob a responsabilidade da Unidade Acadêmica de Serra Talhada desta Universidade, no período de setembro de 2017 a setembro de 2019, tendo como Coordenador o Professor IVANCIL TIBÚRCIO CAVALCANTI, cujo objetivo geral é identificar se há relações de causalidade entre volatilidade de preços ocorridas nos contratos futuros de taxas do mercado interbancário (DI) e de taxa de câmbio (dólar comercial) sobre a volatilidade de preços das ações PETR4, VALE5, BBDC4, GGBR4 e CSNA3, USIM5, PCAR4, BBAS3, AMBEV4, SDIA4, TNLP4, LREN3, EMBR3, negociadas na BM&FBOVESPA e como se estabelecem, conforme consta do Processo acima mencionado.

Art. 2º - Revogam-se as disposições em contrário.

SALA DOS CONSELHOS DA UFRPE, em 15 de junho de 2018.

PROFA. MARIA JOSÉ DE SENA
= PRESIDENTE =