

7. Referências bibliográficas

ASSAF NETO, A. **Mercado Financeiro**. 5.ed. São Paulo: Atlas, 2003.

DUARTE JR. A. M. **Gestão de riscos para fundos de investimentos**. São Paulo, Prentice Hall, 2005.

ELTON, E.; GRUBER, M. **Modern portfolio theory and investment**. New York: John Wiley & Sons, Inc, 1991.

GUTIERREZ CASTRO, J. **Otimização da Performance de um Portfólio de Ativos e Opções Reais, Utilizando a Medida Omega (Ω)**. Tese de Doutorado - Departamento de Engenharia Industrial, Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro, 2008.

JENSEN, C. M. **The performance of mutual funds in the period 1945-1964**. The Journal of Finance, 23, n° 2, 389-416, 1968.

KAZEMI, H.; SCHNEEWEIS, T.; GUPTA R. **Omega as a Performance Measure**. Working Paper CISDM. University of Massachusetts, Isenberg School of Management, 2003.

KEATING, C.; SHADWICK, W. **A Universal Performance Measure**. Journal of Performance Measurement, p.59-84, 2002.

MARKOWITZ, H. M. **Portfolio selection**. Journal of Finance, v.7, n° 1, 77-91, 1952.

SAMANEZ, C. P. **Gestão de Investimentos e Geração de Valor**. São Paulo, Prentice Hall, 2007.

SHARPE, W. F. **Mutual fund performance**. Journal of Business, 39, n°1, 119-138, 1966.

The Sharpe Ratio. Journal of Portfolio Management, v.21, n°1, 49-58, Fall, 1994.

SORTINO, F.; Lee, N. **Performance Measurement in a Downside Risk Framework.** The Journal of Investing, Fall, 1994.

TREYNOR, J. **How to rate management of investment funds.** Harvard Business Review, 43, n°1, 63-75, 1965.

VARGA, G. **Índice de Sharpe e outros Indicadores de Performance Aplicados a Fundos de Ações Brasileiros.** IbmeC/SP, 1999.

XAVIER, A. L. B. **Persistência de performance: fundos multimercado com renda variável e alavancagem.** Dissertação de Mestrado Profissionalizante apresentada ao Programa de Pós-Graduação em Administração das Faculdades IbmeC, Rio de Janeiro, 2008.

SÍTIOS NA INTERNET:

<http://www.anbid.com.br> : Acesso em 5 de agosto de 2011.

<http://www.capes.gov.br/>: Coordenação de Aperfeiçoamento de Pessoal de Nível Superior (CAPES). Banco de dissertações e teses. Acesso em 17 de agosto de 2011.

<http://www.cvm.gov.br>: Comissão de Valores Mobiliários (CVM). Acesso em 11 de setembro de 2011.

<http://www.receita.fazenda.gov.br> : Acesso em 12 de agosto de 2011.

SOFTWARES UTILIZADOS: Gretl, Excel e Word.