

DEDALUS - Acervo - EESC

3110004/637



Anais de Resumos

Editado por
José Luis Duarte Ribeiro
Celso Fritsch
Adriana Ferreira de Faria
Romir Soares de Souza Filho

Publicado por
 **ABEPRO**
Associação Brasileira de Engenharia de Produção

E56

XXIII Encontro Nacional de Engenharia de Produção ENESEP 2003 Anais de Resumos

Ouro Preto, MG, Brasil, 21 a 24 de outubro de 2003

Publicado por

ABEPRO - Associação Brasileira de Engenharia de Produção

Editores

José Luis Duarte Ribeiro

Universidade Federal do Rio Grande do Sul

Celso Fritsch

Universidade Federal do Rio Grande do Sul

Adriana Ferreira de Faria

União Educacional Minas Gerais

Romir Soares de Souza Filho

Universidade Federal de Juiz de Fora

Produção Gráfica

Denise Martins Chagas

Universidade Federal do Rio Grande do Sul

Autoria da capa

Eduardo Breviglieri de Castro Pereira

Romir Soares de Souza Filho

Universidade Federal de Juiz de Fora

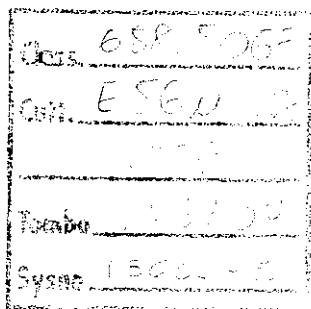
Desenvolvido no



**LOPP
UFRGS**

*Laboratório de Otimização de Produtos e Processos
Programa de Pós-Graduação em Engenharia de Produção
Escola de Engenharia
Universidade Federal do Rio Grande do Sul*





Catálogo-na-Publicação (CIP). UFRGS. Escola de Engenharia. Biblioteca

E56a

Encontro Nacional de Engenharia de Produção

(23: 2003: Ouro Preto, MG)

Anais de Resumos / XXIII Encontro Nacional de Engenharia de Produção;

editores: José Luis Duarte Ribeiro... [et al.]; produção gráfica: Denise
Martins Chagas. - Porto Alegre: ABEPRO, 2003.

ISBN 85-88478-06-4

1. Engenharia de Produção - Evento. I. ENEGEP. II. Ribeiro, José Luis
Duarte. III. Chagas, Denise Martins. IV. Título.

CDU 658.5 (063)

Evento dos anúncios de fusões e aquisições de firmas negociadas na BOVESPA, ocorridos entre jul./94 e jul./02. No cálculo dos retornos anormais, foi utilizado o Modelo de Mercado, adaptado pelo procedimento Trade-to-trade. Conclui-se que, apesar dos avanços, o mercado de capitais brasileiro não se comportou de maneira eficiente informacionalmente no período analisado no que se refere à forma semiforte. O que analisado em conjunto com as outras pesquisas levantadas, elaboradas com outros eventos, contraria ao modelo de eficiência de mercado para essa forma.

Área: Gestão Econômica / Outros - Gestão Econômica

Palavras-chave: Eficiência de Mercado, Estudo de Evento, Fusões e Aquisições.

Aplicação de modelos de redes neurais na elaboração e análise de clusters macroeconômicos

Maurílio Benite (USP), Marcelo Seido Nagano (USP), João Vitor Moccellini (USP)

Este estudo versa sobre uma investigação de viabilidade da utilização de redes neurais auto-organizadas na classificação e exploração de dados macroeconômicos. Para tanto, foi elaborado um método no qual foram empregadas uma topologia neural auto-organizada na realização deste tipo de tarefa. Os resultados obtidos sugerem que a utilização de redes neurais artificiais auto-organizadas na aquisição de conhecimento sobre bases de dados aplicáveis às Ciências Econômicas apresenta desempenho análogo aos modelos paramétricos tradicionalmente empregados na construção de cenários com tais informações.

1368635

14.04.04

Área: Gestão Econômica / Outros - Gestão Econômica

Palavras-chave: Redes neurais auto-organizadas; Dados macroeconômicos; Geração de Clusters.

Avaliação de performance empresarial através de análise envoltória de dados (dea) baseada em índices financeiros

Selma Vellozo Fontes (UFRural/RJ), Marcelo Alvaro da Silva Macedo (UFRural/RJ)

Este artigo consiste em apresentar um método de avaliação de performance empresarial desenvolvido a partir da análise envoltória de dados e de índices financeiros. A finalidade da metodologia proposta é caracterizar organizações eficientes e ineficientes bem como, identificar as variáveis que podem ser trabalhadas para gerar um melhor resultado para as organizações dadas como ineficientes pelo modelo. Foram utilizadas trinta e nove indústrias de diversos segmentos para exemplificar a metodologia proposta. Os resultados obtidos mostraram o quanto o modelo é eficiente no que se propõe a realizar. Na análise foram destacadas as empresas consideradas eficientes, que serviram como benchmarking, e as não eficientes. Foi possível, através da aplicação do modelo, identificar quais seriam as variáveis ótimas aplicadas nas empresas ineficientes para transformar as mesmas em empresas eficientes.

Área: Gestão Econômica / Outros - Gestão Econômica

Palavras-chave: Análise Envoltória de Dados, Performance Empresarial, Benchmarking

Detalhes do laureado artigo prêmio nobel de black e scholes

Tara Keshar Nanda Baidya (PUC/RJ), Fernando Antônio Lucena Aiube (PUC/RJ), Ernesto Kazuhiro Nomi (PUC/RJ)

O modelo de Black e Scholes de apuração de uma opção de compra é o artigo mais discutido no mundo acadêmico e fora dele. Ao tentar ler o artigo original, encontra-se muita dificuldade na sua completa compreensão pois muitas demonstrações são omitidas. O propósito de artigo é o esclarecimento de todas as etapas dessa demonstração até a obtenção do resultado final.

Área: Gestão Econômica / Outros - Gestão Econômica

Palavras-chave: Opções, Derivativos, Black e Scholes.

SYSNO 1368635
PROD 002538

ACERVO EESC