

## **MAE-0518: Modelagem em Séries Temporais Financeiras**

Prof. Pedro A. Morettin

### **Programa**

1. Preliminares
2. Modelos lineares univariados
3. Modelos heterocedásticos condicionais
4. Valores extremos, VaR
5. Modelos multivariados.
6. Processos co-integrados.
7. Análise de dados de alta frequência

### **Referências**

- Alexander, C. (2001). Market Models. Wiley.
- Franses, P.H.(1998). Time Series Models for Business and Economic Forecasting. Cambridge University Press.
- Morettin, P.A. (2004). Econometria Financeira . Texto Preliminar.
- Taylor, S. (1986). Modelling Financial Time Series. Wiley.
- Tsay, R.S. (2002). Analysis of Financial Time Series. Wiley.