

Lista 2

- 1) Escreva a verossimilhança do modelo GARCH(1,1) gaussiano.
- 2) Ajuste o modelo GARCH para os log retornos de uma ação e apresentem a análise de resíduos completa.
- 3) Escreva a verossimilhança do modelo SETAR (Tong) gaussiano com 2 regimes.