

MAE 518 – SÉRIES TEMPORAIS FINANCEIRAS

Lista #4

1. Verifique se as séries de retornos diários da Petrobras e da Vale apresentam componente de longa memória. Em caso afirmativo, ajuste modelos ARFIMA adequados.

2. Considere as séries de retornos diários da Petrobras e da Vale. Considere as séries de retornos ao quadrado, $v_t = r_t^2$, para cada uma delas, como representando as séries de volatilidades.
 - a) Calcule as funções de autocorrelação e autocorrelação parcial amostrais das séries v_t e comente.
 - b) Faça um teste de longa memória para as séries v_t .
 - c) Caso seja adequado, ajuste modelos FIGARCH e FIEGARCH para cada uma delas.

PRAZO DE ENTREGA : 31/05/2012