

MEMÓRIA LONGA – S+FINMETRICS

- **Função rosTest** → Modified R/S Test (dados diários utilize $K1=5$ e $f=2$)
- **Função gphTest** → Procedimento GPH
- **FARIMA** → ajustamento e previsão de modelos ARFIMA com $d > -0,5$
- **d.white** → modelo ARFIMA(0,d,0)

Para fazer o diagnóstico mdo modelo ajustado: `plot(nome do modelo)`

Função fgarch → ajusta modelos figarch e fiegarch

Ex: modelo figarch para log retornos não correlacionados

```
ribv.figarch=fgarch(ribv~1,figarch(1,1))
```

modelo fiegarch para log retornos não correlacionados

```
ribv.fiegarch=fgarch(ribv~1,fiegarch(1,1), leverage=T)
```