

MAE-518- Modelagem em Séries Temporais Financeiras

1^o Semestre de 2002. 1^a Lista de Problemas.

1. Considere os log-retornos diários do Banespa, de 2/1/1995 a 27/12/2000.

(a) Faça um gráfico da série. Calcule as estatísticas: média, variância, assimetria, curtose, mínimo e máximo. Comente.

(b) Obtenha um histograma dos dados e comente sobre a forma da distribuição; compare com a distribuição normal de mesma média e variância.

(c) Comente sobre a significância da média (média nula) e teste se a série é ruído branco.

2. Mesmo problema para os log-retornos mensais do Ibovespa, de Junho/1994 a Agosto/2001.

3. Para os dados do Problema 2:

(a) Qual é o log-retorno médio anual sobre o período dos dados?

(b) Qual é o retorno simples médio anualizado?

(c) Se voce investir 1R\$ no ativo, no começo de Junho de 1994, qual era o valor do investimento no final de Agosto de 2001?