

## **Econometria em Finanças**

Prof. Pedro A. Morettin

### **Programa**

1. Preliminares; retornos.
2. Processos estocásticos; modelos lineares univariados, ARIMA.
3. Construção de modelos ARIMA.
4. Testes de raízes unitárias.
5. Modelos heterocedásticos condicionais: ARCH, GARCH e extensões.
6. Valor em Risco (VaR).
7. Modelos multivariados: VAR, VARMA.
8. Processos co-integrados, modelos de correções de erros, testes de co-integração.

### **Referências**

Campbell, J.Y., Lo, A.W. and MacKinlay, A.C. (1997). *The Econometrics of Financial Markets*. Princeton University Press.

Enders, W. (1995). *Applied Econometric Analysis*. Wiley.

Hamilton, J.D. (1994). *Time Series*. Princeton University Press.

Mills, T.C. (1999). *The Econometric Modelling of Financial Time Series*. Cambridge University Press.

Tsay, R. (2002). *The Analysis of Financial Time Series*. Wiley.

IME-USP, Sala 208, Bloco A

Telefone: 3091-6125; Fax: 3091-6130

e-mail: pam@ime.usp.br

<http://www.ime.usp.br/pam>