

## **Lista 5 – Time Series (ARMA e família GARCH)**

Nesta lista você terá que aplicar os exercícios selecionados do livro Tsay (2005) para séries compatíveis no mercado brasileiro, quando aplicável, comparando os resultados com os dados americanos. Por séries compatíveis entendem-se aquelas de frequência semelhantes e ativos que representam mesmo setor ou portfólio.

Dados Tsay (2005):

<http://faculty.chicagobooth.edu/ruey.tsay/teaching/fts2/>

### **Modelos ARMA:**

Exercícios 2.3, 2.7, 2.8, 2.9, 2.10, 2.11 e 2.15

(entrega dia [05/03](#))

### **Modelos família GARCH**

Exercícios 3.6, 3.7, 3.8, 3.9, 3.10, 3.13, 3.14, 3.15

(entrega dia [12/03](#))