



UNIVERSIDADE FEDERAL DE SÃO CARLOS

Campus Sorocaba

Centro de Ciências em Gestão e Tecnologia

Coordenação do Curso de Ciências Econômicas

Rodovia João Leme dos Santos (SP 264), Km 110

Bairro: Itinga - Sorocaba - São Paulo - Brasil - CEP: 18052-780

Fone: (15) 3229-5949

ECONOMETRIA FINANCEIRA - 496200

I – DEPARTAMENTO DE OFERTA: Departamento de Economia – DEc-So

II – CARGA HORÁRIA: 60h / 4 créditos

III – PERFIL DE OFERTA / CARÁTER: 8º perfil / optativa

IV – REQUISITOS: “Econometria 2”.

V – OBJETIVOS: Apresentar aos alunos o instrumental básico para trabalhar adequadamente com dados financeiros, os quais possuem características peculiares e necessitam de técnicas específicas de estimação. Além do aprendizado do instrumental, a disciplina objetiva, também, fornecer experiências práticas nos principais temas em finanças: apreçamento de ativos, alocação de carteiras e gestão de riscos.

VI – EMENTA: Dados Financeiros: Fato Estilizados. Processos Estocásticos (Movimento Browniano e Martingales). Modelos para Volatilidade. Processos com Memória Longa. Análise de Dados de Alta Frequência. Análise de Dependência e Cópulas. Aplicações.

VII – BIBLIOGRAFIA BÁSICA

- BUENO, R. L. S. Econometria de Séries Temporais. São Paulo: Cengage Learning, 2008.
- CAMPBELL, J. Y.; Lo, A. W.; MACKINLAY, C. A. The Econometrics of Financial Markets. Princeton, NJ: Princeton University Press, 1997.
- ENDERS, W. Applied Econometric Time Series. Wiley, 2010.
- MORETTIN, P.A. Econometria Financeira. Blucher, 2008
- WOOLDRIDGE, J. Introdução à Econometria: uma abordagem moderna. Cengage Learning, 2011.
- TSAY, R. S. Analysis of Financial Time Series: Financial Econometrics. John Willey & Sons, Inc., 2005.