



UNIVERSIDADE FEDERAL DE SÃO CARLOS

Centro de Ciências em Gestão e Tecnologia

Programa de Pós-Graduação em Administração

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

Sorocaba – SP, CEP 18052-780. Telefone: (15) 3229-7456



Programa:	Programa de Pós-Graduação em Administração		
Disciplina:	Econometria Financeira	Código:	ADM-204
Nível:	Mestrado Acadêmico	Tipo:	Optativa
Créditos:	8	Carga Horária:	120 hs
Objetivos: O objetivo desta disciplina é apresentar 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, além de treinamento no <i>software</i> R.			
Ementa: <ul style="list-style-type: none">- Dados Financeiros: Fato Estilizados; (teórico)- Processos Estocásticos (Movimento Browniano e Martingales); (teórico)- Modelos de previsão para a média; (teórico)- Modelos para Volatilidade; (teórico)- Aplicações. (teórico/aplicado)			
Bibliografia: <p>BODIE, Z.; Kane, A.; Marcus, A. J. Investments. McGraw-Hill Education, 11 ed., 2017.</p> <p>BOLLERSLEV, T.; XU, L.; ZHOU, H. Stock return and cash flow predictability: The role of volatility risk. Journal of Econometrics, v. 187, n. 2, p. 458-471, 2015.</p> <p>BUENO, R. L. S. Econometria de Séries Temporais. São Paulo: Cengage Learning, 2008.</p> <p>CAMPBELL, J. Y.; LO A. W.; MACKINLAY C. A.; ADAMEK P.; VICEIRA L. M. The Econometrics of Financial Markets. Princeton, NJ: Princeton University Press, 1997.</p> <p>CHAIM, P.; LAURINI, M. P. Is Bitcoin a bubble? Physica A: Statistical Mechanics and its Applications, v. 517, p. 222-232, 2019.</p> <p>ELLIOT, G.; TIMMERMANN, A. Economic Forecasting. Princeton University Press, 2016.</p> <p>ENDERS, W. Applied Econometric Time Series. Wiley, 2010.</p> <p>GHYSELS, Eric; MARCELLINO, Massimiliano. Applied Economic Forecasting Using Time Series Methods. Oxford University Press, 2018.</p> <p>HANSEN, B. E. Econometrics: Available on-line, 2018. at: http://www.ssc.wisc.edu/~bhansen/econometrics/</p> <p>LAURINI, M. P.; HOTTA, L. K. GMC/GEL estimation of stochastic volatility models. Communications in Statistics-Simulation and Computation, v. 46, n. 9, p. 6828-6844, 2017.</p> <p>MORETTIN, P.A. Econometria Financeira. Blucher, 2008.</p> <p>TSAY, Ruey S. Analysis of Financial Time Series: Financial Econometrics. John Wiley & Sons, Inc., 2005.</p> <p>WOOLDRIDGE, J. Introdução à Econometria: uma abordagem moderna. Cengage Learning, 2011.</p>			