

Trabalho de grupo Econometria os Mercados Financeiros

15 de novembro de 2019

Diana Mendes (deam@iscte-iul.pt)

Deadline entrega: 03 de dezembro de 2019

Todos os trabalhos contem 2 bases de dados.

1. A primeira base é um ficheiro csv com dados de tipo cross-section. De preferência usar um modelo de regressão linear.
2. A segunda base é um ficheiro csv com dados de tipo séries temporais. Escolha apenas uma das variáveis (série temporal) e faz a sua análise. De preferência usar um modelo da família ARMA e / ou GARCH.

Questões:

1. Analisar gráficos e estatísticas descritivas das variáveis
2. Analisar a estacionariedade das variáveis (quando se trata de séries temporais).
3. Descobrir o melhor modelo que se ajusta aos dados e justificar a escolha do respetivo modelo.
4. Analisar as propriedades dos resíduos dos modelos estimados (do melhor modelo de cada base de dados)
5. Fazer a previsão *out-of-sample* de cada uma das variáveis de interesse, um ponto no futuro

Observações:

1. As questões devem ser analisadas de acordo com a sua pertinência face aos dados analisados.
2. As respostas devem incluir o suporte teórico dos modelos, resultados obtidos e sua interpretação. Não deve colocar *output's* de Eviews no trabalho (podem ser apresentados num anexo), mas, sim, tabelas e conclusões.
3. A interpretação dos resultados deve ser efetuada de forma crítica e não apenas factual.
4. O trabalho tem um limite de 25 páginas.
5. De preferência entregar o trabalho via email em formato pdf ou notebook Jupyter.
6. Deve usar o software Python para a realização do trabalho.