

## **Análise de Series Temporais Financeiras em R**

**Objectivos:** Dar a conhecer as principais técnicas de análise de séries temporais, na análise da rentabilidade e da volatilidade. Implementação, através da linguagem de programação R, dos principais modelos.

### **Programa de Formação:**

#### **1. Introdução**

- (a) As características das séries temporais financeiras
- (b) Linguagem de programação R

#### **2. Modelos Lineares**

- (a) Estacionaridade
- (b) Correlação and Autocorrelação
- (c) Modelo AR
- (d) Modelo MA
- (e) Modelo ARMA
- (f) Modelos Não-estacionários com raiz unitária

#### **3. Modelos de Heterocedasticidade Condicional**

- (a) Volatilidade
- (b) Modelo ARCH
- (c) Modelo GARCH
- (d) Modelo I-GARCH
- (e) Modelo GARCH-M
- (f) Modelo E-GARCH

#### **4. Outros modelos não-lineares**



## **Informações de Funcionamento**

**Duração:** 21 horas

**Local da Formação:** Edifício Leonardo da Vinci, Iparque, Coimbra.

**Datas :**

- Limite para Inscrições: 30 de Junho.
- Início da Formação: 7 de Julho.

**Horário:**

- 7/7/2018, 14/7/2018 e 21/7/2018, das 9h30m até às 13h, e das 14h30m até às 18h.

**Preço:** 150€

**Pagamento:**

- 50% na inscrição
- 50% no final do curso

**Formalização da Inscrição:** Remeter a Ficha de Inscrição(link) e o comprovativo de pagamento para [catgat.geral@gmail.com](mailto:catgat.geral@gmail.com).

**Contacto para Informações:** [catgat.geral@gmail.com](mailto:catgat.geral@gmail.com).