**Título**

Métodos antecipativos e adaptativos em Finanças

**Descrição**

A modelagem do retorno de ativos tem evoluído consideravelmente a partir de Markowitz com o tradicional modelo de média-variância para alocação ótima de ativos. Ao longo das décadas os desenvolvimentos dos modelos estatísticos e matemáticos para séries temporais são naturalmente aplicáveis no mercado financeiro. Apesar disso, alguns recursos dessas ciências exatas “puras” podem não ser tão familiares para quem trabalha com o Mercado Financeiro. Nesse encontro iremos apresentar de forma intuitiva e acessível alguns recursos matemáticos e estatísticos que ajudam lidar das dificuldades encontradas no estudo de séries financeiras, dentre eles, dimensionalidade e complexidade. Os métodos de amostragem aleatória Bootstrap, Monte Carlo e MCMC serão apresentados e ao final esperamos que você consiga distingui-los e perceber a utilidade de cada um no estudo de séries financeiras. Tais estratégia de amostragem aleatória em uma abordagem sequencial combinada com a capacidade antecipativa e adaptativa dos Modelos Dinâmicos dão origem ao método de Filtro de Partículas. É desejado um conhecimento básico no Teorema de Bayes. Acesse um material sugerido [aqui](https://lamfo-unb.github.io/2017/08/04/Uma-visao-amigavel-do-Teorema-de-Bayes/).

**Palestrante**

Igor Ferreira do Nascimento

**Currículo**

Possui graduação em Estatística pela Universidade de Brasília e mestrado em Estatística e Métodos Quantitativos pela Universidade de Brasília. Foi Analista de Investimento nas áreas de Risco, Macro Alocação e Cenário da FUNCEF. Atualmente é Professor de Estatística no Instituto Federal do Piauí (IFPI). Doutorando em administração com eixo temático de Finanças e Métodos Quantitativos pela Universidade de Brasília.