

Lista 4

1. Problemas 3.17, 3.18 e 3.24 da referência.
2. Faça uma análise tão detalhada quanto possível dos componentes principais (PCA) da Estrutura a Termo da Taxa de Juros (ETJ) brasileira. Os dados necessários estão no objeto `prices_Swap_PRE_DI` dentro do arquivo `Dropbox\Shared\Estatistica_Econometria_IMPA_2017\prices_Swap_PRE_DI.RData`. Importe-o usando a função `load` do R.

Referência: Carmona, René. Statistical analysis of financial data in R, 2013.