

Universidade Federal de São Carlos
Departamento de Economia
Econometria Financeira: Análise de Séries Temporais usando o R
Profa. Dra. Andreza A. Palma

Instruções Gerais

- Você deve criar um novo documento RMarkdown e responder as questões usando este documento no R.
- Você deverá entregar no AVA/Moodle o seu arquivo .RMD
- Para corrigir, eu irei analisar o arquivo .RMD, gerando o HTML. Portanto, teste antes de enviar se tudo está funcionando adequadamente.
- Não receberei as atividades via e-mail. Apenas via AVA/Moodle.
- Note que para cada exercício que exija um código no R, vc deve utilizar um *chunk*. A organização do seu arquivo também será avaliada.

Homework 1

1. Você deve escolher 4 (quatro) variáveis disponíveis no Yahoo Finance e verificar os fatos estilizados de séries temporais financeiras, seguindo aproximadamente o que foi mostrado na aula.
2. *Extra* Calcule as principais estatísticas descritivas das variáveis: média, desvio-padrão, variância, curtose, assimetria, etc.
3. *Extra* Calcule o coeficiente de correlação entre dois retornos e faça o gráfico de dispersão.
4. *Extra* Você pode fazer também o mapa de calor para as correlações entre os quatro ativos escolhidos.