

SME0808 Séries Temporais  
ICMC-USP Ricardo Ehlers  
Lista 7

1. Um modelo ARIMA foi identificado e estimado para uma série temporal observada mas há indicação de que a variância condicional deve ser modelada por um processo GARCH(1,1). Explique como se chegou a esta conclusão.
2. Obtenha as previsões 1, 2 e 3 passos a frente para um modelo GARCH(1,2).
3. Descreva duas vantagens de modelos EGARCH sobre modelos GARCH.
4. Faça os exercícios do Capítulo 12 (Modelos Não-lineares) em Morettin & Toli.