

1.  
Apresentação geral

2.  
Objetivo geral

3.  
Programa resumido

4.  
Bibliografia principal

1.

**Curso:** Mestrado em Análise Financeira

**Área/ Subárea:** Finanças

**Semestre:** 2º

**Carga horária:** 3H

**ECTS:** 6

2.

Pretende-se que os alunos sejam capazes de aplicar modelos econométricos lineares e não-lineares na análise de séries financeiras temporais, *cross-sections* e dados em painel bem como dos métodos inerentes à análise técnica de valores.

3.

Capítulo 1 – Distribuições de probabilidades;  
Capítulo 2 – Inferência;  
Capítulo 3 – Correlação e regressão;  
Capítulo 4 – Modelos de séries temporais univariados;  
Capítulo 5 – Modelos de séries temporais multivariados;  
Capítulo 6 – Modelos de dados em painel;  
Capítulo 7 – Métodos de simulação

4.

Brooks, C. (2014) *Introductory Econometrics for Finance*, 3<sup>rd</sup> Ed., Cambridge University Press: Cambridge:

Campbell, J.Y., Lo, A.W. and MacKinlay, A.C. (1997), *The Econometrics of Financial Markets*, Princeton University Press: Princeton, NJ.

Cochrane, J.H. (2005) *Asset Pricing: Revised Edition*, Princeton University Press: Princeton.

Gujarati, D., Porter, D.C. (2010) *Essentials of Econometrics*, 4<sup>th</sup> Ed., McGraw-Hill International Editions: New York.

Verbeek, M. (2012) *A Guide to Modern Econometrics*, Wiley: Chichester.