

Disciplina:

ADM2840 - Tópicos Avançados em Finanças I

Ementa:

Utilização de Modelos de machine learning e sua aplicação em estudos na área de finanças e replicação no R. Desenvolver estudos empíricos em finanças aplicando diversos métodos estatísticos e econométricos.

Bibliografia:

Básica: -James, G., Witten, D., Hastie, T, Tibshirani, R. An Introduction to Statistical Learning with Applications in R. Springer Verlag, New York, Corrected Edition 2017. Bibliografia complementar: •Bali, Turan G., Engle, Robert F., Murray, Scott. Empirical Asset Pricing – The Cross Section of Stock Returns. John Wiley & Sons, Inc, Hoboken, New Jersey, 2016. •Cochrane, John. Asset Pricing, Revised Edition. Princeton University Press, Princeton, New Jersey, 2005. •Ruppert, David, Matteson, David S. Statistics and Data Analysis for Financial Engineering. Second Edition. Springer: New York, 2015 •Tsay, Ruey S. An Introduction to the Analysis of Financial Data with R. Wiley: New Jersey, 2013 •TSAY, Ruey S. Analysis of Financial Time Series. Third Edition. Wiley: New Jersey, 2010. •KLEIBER, Christian; ZEILEIS, Achim. Applied Econometrics with R. Springer: New York, 2008 •BROOKS, Chris. Introductory Econometrics for Finance. Cambridge University Press: Cambridge, Third Edition, 2014