

ASSOCIAÇÃO NACIONAL DAS INTUIÇÕES DO MERCADO FINANCEIRO – ANDIMA. Disponível em: <<http://www.andima.com.br/>>. Acesso em: setembro de 2008.

AGENCIA NACIONAL DE SAÚDE SUPLEMENTAR – ANS. Disponível em: <<http://www.andima.com.br/>>. Acesso em: dezembro de 2008.

BANCO CENTRAL DO BRASIL – BACEN. Disponível em: <<http://www.bcb.gov.br/>>. Acessado em: dezembro de 2008.

BROCKWELL, P. J.; DAVIS, R. A. (2002). *Introduction to Time Series and Forecasting*. 2ª edição. New York. Springer-Verlag.

BROCKWELL, P. J.; DAVIS, R. A. (1991). *Time Series: Theory and Methods*. 2ª edição. New York. Springer-Verlag.

BROWN, S. J.; GOETZMANN, W. N. (2003). “Hedge Funds with Style”. *The Journal of Portfolio Management*, Winter, p. 101-112.

COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS – CMV. Disponível em: <www.cvm.gov.br/>. Acesso em: dezembro de 2008.

DE JONG, P. (1991). “The diffuse Kalman filter”. *The Annals of Statistics*, vol. 19, No. 2, p. 1073-1083.

DE JONG, P.; CHU-CHUN-LIN, S. (2003). “Smoothing with an Unknown Initial Condition”. *Journal of Time Series Analysis*, Vol. 24, No. 2, p. 141- 148.

DE ROON, F. A.; NIJMAN, T. E.; TER HORST, J. R. (2004). “Evaluating Style Analysis”. *Journal of Empirical Finance*, Volume 11, Issue 1, p. 29-53.

DOORNICK, J. A. (2001). *Ox 3.0: An Object-Oriented Matrix Programming Language*. Timberlake Consultants LTD.

DURBIN, J.; KOOPMAN, S. J. (2001). *Time Series Analysis by State Space Methods*. Oxford Statistical Science Series.

HAMILTON, J. D. (1994). *Time Series Analysis*. Princeton University Press.

HARVEY, A. C.; PHILLIPS, G. D. A. (1979). “The estimation of regression models with autogressive-moving average disturbances”. *Biometrika*, 66,49-58.

HARVEY, A. C. (1989). *Forecasting, Structural Time Series Models and The Kalman Filter*. Cambridge University Press.

HARVEY, A. C. (1993). *Time Series Models*. 2ª edição. Harvester Wheatsheaf.

JOHNSON, R. A.; WICHERN, D. W. (1998). *Applied multivariate statistical analysis*. 4ª edição. New Jersey. Prentice Hall Inc.

KOOPMAN, S. J.; DURBIN, J. (2003). “Filtering and Smoothing of State Vector for Diffuse State-Space Models”. *Journal of Times Series Analysis*, Vol. 24, No. 1, p. 85-98.

OXMETRICS SOFTWARE – Disponível em: <<http://www.oxmetrics.net/>>. Acesso em: março de 2008.

PIZZINGA, A.; FERNANDES, C. (2006). “State Space Models for Dynamic Style Analysis of Portfolios”. *Brazilian Review of Econometrics*, vol.26, 1, p. 31-66.

PIZZINGA, A.; FERNANDES, C.; JUNGER, W. (2007). "Nonlinear State Space Methods for the Estimation of a Dynamic Asset Class Factor Model". *Estadística*, v. 59, p. 55-86.

PIZZINGA, A.; VEREDA, L.; ATHERINO, R.; FERNANDES, C. (2008). "Semi-strong dynamic style analysis with time-varying selectivity measurement: Applications to Brazilian exchange-rate funds". *Applied Stochastic Models in Business and Industry*, v. 24, p. 3-12.

PIZZINGA, A. (2009). "Restricted Kalman Filtering: additional results". *Artigo submetido*. Instituto de Gestão de Riscos Financeiros e Atuariais da PUC-Rio.

PIZZINGA, A.; VEREDA, L.; FERNANDES, C. (2009). "A dynamic style analysis of exchange rate funds: the case of Brazil at the 2002 Election". *Artigo submetido*. Instituto de Gestão de Riscos Financeiros e Atuariais da PUC-Rio.

POSTHUMA, N.; VAN DER SLUIS, P. J. (2005). "Analysing Style Drift in Hedge Funds". Em G. N. GREGORIOU, G. HÜBNER, N. PAPAGEORGIOU e D. ROUAH. *Hedge Funds: Insights in Performance Measurement, Risk Analysis, and Portfolio Allocation*. John Wiley & Sons Inc. p. 83-104.

THE R PROJECT FOR STATISTICAL COMPUTING. Disponível em: <<http://cran.r-project.org/>>. Acesso em: outubro de 2008.

RISKOFFICE. Disponível em: <<http://riskoffice.net/>>. Acesso em: abril de 2008.

SHARPE, W. F. (1988). "Determining a Fund's Effective Asset Mix". *Investment Management Review*, p. 59-69.

SHARPE, W. F. (1992). "Asset Allocation: Management Style and Performance Measurement". *The Journal of Portfolio Management*, Winter, p. 7-19.

SHUMWAY, R. H.; STOFFER, D. S. (2006). *Time Series Analysis and Its Applications (With R Examples)*. 2ª edição. Springer.

SECRETARIA DE PREVIDÊNCIA COMPLEMENTAR – SPC. Disponível em:
<http://www1.previdencia.gov.br/pg_secundarias/previdencia_complementar.asp
>. Acesso: em janeiro de 2009.

SUPERINTENDÊNCIA DE SEGUROS PRIVADOS – SUSEP. Disponível em:
<<http://www.susep.gov.br>>. Acesso em: janeiro de 2009.

SWINKELS, L.; VAN DER SLUIS, P. J. (2006). “Return-based style analysis with time-varying exposures”. *European Journal of Finance*, vol. 12, p. 529-552.

TANIZAKI, H. (1996). *Nonlinear filters*. 2ª edição. Springer.

VARGA, G. (1999). “Índices de Renda Fixa para o Brasil”. *Resenha BM&F*, nº 131.

VARGA, G.; VALLI, M. (1998). “Análise de estilo baseada no retorno”. *Revista da ANBID*, nº 66.

VARGA, G.; WENGERT, M. (2003). “Riscos comuns em fundos de investimentos”. *Gestão de riscos no Brasil. Rio de Janeiro: Financial Consultoria*.

WEST, M.; HARRISON, J. (1997). *Bayesian Forecasting and Dynamic Models*. 2ª edição. Springer-Verlag.

WICHERN, D.; JOHNSON, W. (2002). *Applied multivariate statistical analysis*. New Jersey: Prentice-Hall, 5ªed.

ZIVOT, E.; WANG, J. (2006). *Modeling Financial Time Series with S-PLUS*. 2ª edição. Springer-Verlag.