

## Referências Bibliográficas

ALBERINI, D. V., BOGUSZEWSKI, L. D. (2008). *Por Dentro do Subprime: a Crise Imobiliária e Seus Impactos na Economia Brasileira*. Vitrine da Conjuntura, Curitiba, v.1, nº 2.

ANDERSON, B. D. O., MOORE, J. B. (1979). *Optimal Filtering*. Prentice Hall.

ASSOCIAÇÃO NACIONAL DAS INSTITUIÇÕES DO MERCADO FINANCEIRO – ANDIMA. Disponível em: <http://www.andima.com.br/>. Acesso em: julho de 2009.

BANCO CENTRAL DO BRASIL – BACEN. Disponível em: <http://www.bcb.gov.br/>. Acesso em: julho de 2009.

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

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

COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS – CVM. Disponível em: <http://www.cvm.gov.br/>. Acesso em: julho de 2009.

DE JONG, P. (1989). *Smoothing and Interpolation With the State-Space Model*. Journal of the American Statistical Association, 84, 1085-1088.

DE ROON, F. A., NIJMAN, T. E., TER HORST, J. R. (2004). *Evaluating Style Analysis*. Journal of Empirical Finance, Volume 11, Issue1, 29–53.

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

FRANKEL, J. A. (1993). *Quantifying International Capital Mobility in the 1980s: On Exchange Rates*. Ed. J.A. Frankel, capítulo 2.

GARCIA, M. (2003). *Brazil in the 21st century: how to escape the high interest trap?*. Rio de Janeiro, RJ, Brasil: Pontifícia Universidade Católica/Departamento de Economia. (Texto para Discussão n. 466).

HARVEY, A. C., PHILLIPS, G. D. A. (1979). *The Estimation of Regression with Autorregressive-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.

KOOPMAN, S. J. (1997). *Exact Initial Kalman Filtering and Smoothing for Nonstationary Time Series Models*. Journal of the American Statistical Association, Vol. 92.

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

MARQUES, R. (2009). *Filtro de Kalman Restrito na Análise de Estilo Semi-forte de Fundos Atuariais*. Dissertação de Mestrado – Instituto de Gestão de Riscos Financeiros e Atuariais, Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro.

MICHEL, R., CARVALHO, L. (2009). *Crescimento Econômico: Setor Externo e Inflação*. IPEA.

MONTEIRO, A. A., HECK, S. K. T. (2003). *Uma Estrutura a Termo Alternativa para o Prêmio de Risco Brasil*. VII Risk Control Coppead.

OBSTFELD, M. (1995). *International Capital Mobility in the 1990s: Understanding Interdependence – The Macroeconomics of the Open Economy*. Ed. P.B. Kenen, Princeton University Press.

OTTEN, R., BAMS, D. (2000). *Statistical Tests for Return-based Style Analysis*. <http://www.fdewb.unimaas.nl/finance/faculty/bams/stattests.pdf>

POSTHUMA, N.; VAN DER SLUIS, P. J. (2005). *Analysing Style Drift in Hedge Funds*. John Wiley & Sons Inc. p. 83-104.

PIZZINGA, A. (2004). *Modelos em espaço de estado com Restrições nas Componentes de Interesse: Aplicações em análise dinâmica de estilo para Fundos de Investimento Brasileiros*. Dissertação de Mestrado – Departamento de Engenharia Elétrica, Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro.

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

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.

PIZZINGA, A. (2008). *Filtro de Kalman Restrito: Teoria, Métodos e Aplicações*. Tese de Doutorado – Departamento de Engenharia Elétrica, Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro.

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

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

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

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

THE R PROJECT FOR STATISTICAL COMPUTING. Disponível em: <http://cran.r-project.org/>. Acesso em: junho de 2009.

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.

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