Programa Institucional de Bolsas de Iniciação Científica
24 a 26 outubro de 2012
Pró-Reitoria de Pesquisa - Pibic/CNPq
Pró-Reitoria de Graduação - SAE/ Unicamp
XX congresso interno de iniciação científica da unicamp 2012

E0635

DADOS DE ALTA FREQUÊNCIA EM FINANÇAS: CARACTERÍSTICAS E MODELAGEM DA VOLATILIDADE

Liamarcia Vicente Bifano (Bolsista PIBIC/CNPq) e Prof. Dr. Luiz Koodi Hotta (Orientador), Instituto de Matemática, Estatística e Computação Científica - IMECC, UNICAMP

O objetivo do projeto é modelar a volatilidade dos preços das ações do Itaú ao longo de um dia. Esses dados financeiros são dados de alta freqüência, pois são obtidos em intervalos pequenos e irregularmente espaçados no tempo. Métodos convencionais de modelagem de volatilidade nem sempre são adequados para esse tipo de série financeira.

Volatilidade realizada - Dados de alta frequência - Modelo HAR-RV