

SALÃO DE
INICIAÇÃO CIENTÍFICA
XXIX SIC
**UFRGS**
PROPESQ



múltipla 
UNIVERSIDADE
inovadora  inspiradora

| | |
|-------------------|---|
| Evento | Salão UFRGS 2017: SIC - XXIX SALÃO DE INICIAÇÃO CIENTÍFICA DA UFRGS |
| Ano | 2017 |
| Local | Campus do Vale |
| Título | Modelagem de volatilidade de ativos financeiros |
| Autor | RENAN FARAON CINTRA |
| Orientador | MARCIO VALK |

Título: Modelagem de volatilidade de ativos financeiros

Autor: Renan Faraon Cintra

Orientador: Marcio Valk

Modelagem de séries temporais consiste basicamente na escolha de modelos que capturem o comportamento padrão de variáveis aleatórias indexadas no tempo. Se os dados apresentam características não favoráveis, entretanto, as propriedades dos estimadores são fortemente afetadas. Por outro lado, quando consideramos dados reais de preços de ativos na bolsa de valores, percebemos que a estrutura é mais complexa do que é possível capturar com modelos tradicionais de séries temporais, como é o caso da família de modelos ARIMA. Uma abordagem corrente no mercado financeiro é a denominada Análise Técnica, onde a identificação de padrões a partir da visualização gráfica e de métodos de Estatística descritiva são os principais instrumentos na tomada decisão. O resultado disso é uma sequência de classificações do ativo de acordo com seu desempenho. Por esse motivo, a modelagem que possa capturar a estrutura desses padrões se torna relevante. O uso de definição de classificação de estados ao longo do tempo, assim, sugere abordagens de Cadeias de Markov e de Redes Neurais.