



Statistică pe Piețe Financiare

Modele avansate de volatilitate



Daniel Traian PELE

Antoaneta Amza

Academia de Studii Economice din București

IDA Institute Digital Assets

Blockchain Research Center

AI4EFin Artificial Intelligence for Energy Finance

Academia Română, Institutul de Prognoză Economică

MSCA Digital Finance

Cuprins

- ▣ Modele GARCH
- ▣ EGARCH și GJR-GARCH
- ▣ Volatilitate realizată
- ▣ Modele HEAVY
- ▣ Volatilitate stocastică
- ▣ Volatilitate implicită
- ▣ Bibliografie

Conținutul va fi adăugat din prezentarea Keynote.

În curând

Conținutul capitolului va fi adăugat.

Acest capitol va acoperi modele avansate de volatilitate, inclusiv GARCH, EGARCH, Volatilitate realizată, modele HEAVY și Volatilitate stocastică, pe baza materialelor din prezentarea Keynote.