

Tento projekt navrhuje postupy pro predikování volatility na finančních trzích, kde vysoko-frekvenční data jsou k dispozici jen pro krátké období, nejsou k dispozici nebo mají nízkou kvalitu. Naším přínosem je, že použijeme skupinu predikčních modelů založených na rozsahových odhadech volatility a porovnáme jejich výkonnost s modely využívajícími vysoko-frekvenční odhady volatility. Komplexní empirické porovnání takových modelů dosud nebylo uskutečněno. Naším dalším přínosem je, že budeme zkoumat, za jakých tržních podmínek jsou predikce založené na rozsahových odhadech volatility přesnější. Ověříme, zda záleží na likviditě, obratu, úrovni volatility nebo cenových diskontinuitách.

Cílem projektu je navrhnout postup predikce volatility, založený na rozsahových odhadech volatility, který bude empiricky testovaný a porovnáváný oproti standardním modelům předpovídajícím volatilitu pomocí realizované volatility.

Navrhovatel projektu: doc. Ing. Štefan Lyocsa, Ph.D.
Období řešení projektu 1. 1. 2018 - 31. 12. 2020
Rozpočet projektu: 2 719 000 Kč