

Desenvolupament i ajust de models estadístics per a dades financeres

Resum de la línia de recerca. En aquesta línia de recerca tractem problemes i metodologies estadístiques que deriven de les matemàtiques per a l'economia financera, àrea del màxim interès internacional com es veu en els mitjans de comunicació i en les revistes científiques.

La nostra recerca es centra especialment en dos temes. En primer lloc, el desenvolupament d'algoritmes simples i eficients per estimar models de volatilitat estocàstica, que són una alternativa realista al model bàsic de Black i Scholes per valorar i cobrir derivats. En segon lloc, desenvolupem nous models senzills i flexibles per a la gestió del risc financer, especialment per al risc operatiu, que proporcionin a la vegada un bon ajust a les dades i unes estimacions acurades del valor en risc.