



PROJETO DE PESQUISA: ANÁLISE DE EFEITO CONTÁGIO POR MEIO DE MODELOS MULTIVARIADOS DE VOLATILIDADE (MGARCH)	
Líder:	Prof. Dr. Pedro Raffy Vartanian
Início:	2018
Situação:	Em andamento
Financiamento:	
Natureza:	Pesquisa
DESCRIÇÃO: O objetivo do projeto é avaliar o contágio de volatilidade entre o preço das commodities e o Ibovespa, com o objetivo de se verificar a possibilidade de diversificação de investimentos. Adicionalmente, pretende-se investigar o contágio em outros mercados, como o de juros e de câmbio.	
Integrantes	Categoria
Carlos Viapiana	Discente (Mestrado)
Pedro Raffy Vartanian (Líder)	Docente