

Timdata eller Dagsdata - Vad predikterar nästkommmande dags volatilitet bäst?

Fredrik Käll*

Juni 2017

Sammanfattning

Vi undersöker i den här uppsatsen om det med hjälp av högre frekvens är möjligt att skapa sig en bättre volatilitetsprediktion än med lägre frekvens. De modeller vi har valt att undersöka är ARCH och GARCH som vi undersöker under både normal- och t-fördelningsantaganden. Vi kommer fram till att en högre frekvens inte skapar en bättre prediktion vilket kan förklaras av att de modellerna skapade med data av högre frekvens kräver prediktion av er steg, vilket leder till större osäkerhet.

*Postadress: Matematisk statistik, Stockholms universitet, 106 91, Sverige.
E-post: fredrik.kall@outlook.com. Handledare: Mathias Lindholm och Filip Lindskog.