

UNICAMP – IMECC
Departamento de Matemática

Seminário de Sistemas Dinâmicos e Estocásticos

Expositor: M. Fernández (UNICAMP)

Título: Geração de cenários de estresse para curva de juros

Data: Sexta-feira, 9 de setembro de 2011, 14h

Local: Sala 321 do IMECC

Resumo. A apresentação descreve uma aplicação da classe de modelos Heath-Jarrow-Morton na geração de cenários de estresse para a estrutura a termo da taxa de juros. Por meio da análise de componentes principais, consegue-se reduzir a dimensão do problema e criar uma ponte entre a informação que um especialista possui para definir cenários, informação geralmente de dimensão baixa, e a robustez do modelo Heath-Jarrow-Morton. A metodologia é aplicada ao mercado brasileiro no auge da crise em 2008 e em outras oportunidades.

Consulte a programação em [www.ime.unicamp.br/ssde].