

IDI&CA 2020 - Ficha de Projeto

Acrónimo	FIN
Coordenação	Sónia Bentes (ISCAL)
Equipa	Harry Eugene Stanley (Boston University) Ana Paula Matias Gama (UBI) Raúl Daniel Navas (ISCAL e UBI) Osvaldo Visitação Caldeira (ISCAL) José Nuno Sacadura (ISCAL) Maria Celeste Canais Filipe (ISCAL) Ricardo Moreira Santos (Banco Montepio) Ana Filipa Botelho Marques (Deloitte)
Parceiros	ISCTE-IUL Boston University (BU) National Academy of Sciences Universidade da Beira Interior Banco BPI
Execução	07.09.2020 a 31.08.2021
Código Ref.^a	IPL/2020/FIN_ISCAL
Âmbito	Este projeto tem como objetivo a análise da persistência (ou memória-longa) nos fenómenos de contágio de crises entre índices de volatilidade implícita, com base em modelos econométricos e de hidrologia.