

6 Bibliografia

ALEXANDER, C. **Modelo de Mercado: Um guia para a análise de informações financeiras**. Bolsa de Mercadorias & Futuro, 2005.

ALMEIDA, C. I. R.; DANA, S. **Stochastic volatility in brazilian stock markets and its impacts on option pricing: an empirical investigation**. Terceiro Encontro Brasileiro de Finanças. Sociedade Brasileira de Finanças, 2003.

ANDERSEN, T.G., T. BOLLERSLEV, F.X. DIEBOLD, & P. LABYS. **Modeling and forecasting realized volatility**. *Econometrica*, v. 71, p. 579-626, 2003.

BECKERS, STAN. Standard Deviations Implied in Option Prices as Predictors of Future Stock Price Variability. **Journal of Banking and Finance**, v. 5, n. 3, p. 363-382, 1981.

BLACK, F.; SCHOLES, M. The pricing of options and corporate liabilities. **Journal of Political Economy**, 81 (3), p. 637-59, 1973.

BMF&Bovespa. **Relatório anual 2010 do Bovespa**. Disponível em <<http://www.bmfbovespa.com.br/pt-br/a-bmfbovespa/download/BMFVOVESPA-Relatorio-Anual-2010.pdf>>. Acessado em: 15 nov. 2011.

BOLLERSLEV, T. Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity. **Journal of Econometrics**, v. 31, n. 3, p. 307-327, 1986.

CASPARY, M. C. **Modelo genetic-neural para otimização de carteiras com opções financeiras no Mercado brasileiro**. Dissertação de Mestrado – Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro, Rio de Janeiro, 2011.

CAVALERI, R; RIBEIRO, E. P. Combinação de previsões de volatilidade: um estudo. **Revista Economia**, Brasília (DF), v. 12, n. 2, p. 239–261, 2011.

EDERINGTON, L.; Guan, W. Measuring historical volatility. **Journal of applied finance**, v. 16, n. 1, 2006.

ENGLE, R.F. **Autoregressive conditional heteroskedasticity with estimates of the variance of United Kingdom inflation**. *Econometrica*, p. 987-1007, 1982.

FIGLEWSKI, STEPHEN. **Forecasting Volatility**. Financial Markets, Institutions & Instruments, v. 6, n. 1, p. 1-88, 1997.

FLEMING, JEFF. **The Quality of Market Volatility Forecasts Implied by S&P 100 Index Option Prices**, Working paper, Jones Graduate School, Rice University, 1994.

HULL, J. C. **Opções, futuros e outros derivativos**. 4 ed. Prentice Hall, 1999.
_____.; WHITE, A. The pricing of options on assets with stochastic volatilities. **Journal of Finance**, v. 42, p. 281-300, 1987.

KATZ, J. O.; CORNICK, D. L. **Advanced option pricing models**. McGraw – Hill, 2005.

JUNIOR, M. V. W. **Modelagem e previsão de volatilidade realizada: evidências para o Brasil**. Dissertação de Mestrado Fundação Getúlio Vargas, São Paulo, 2011.

LAMOUREUX, C.; LASTRAPES, W. Forecasting stock return variance: toward an understanding of stochastic implied volatilities. **Review of Financial Studies**, p. 293-326, 1993.

MORAIS, I. A. C., PORTUGAL, M. S. **Modelagem e Previsão de Volatilidade Determinística e Estocástica para a Série do Ibovespa**. Estudos Econômicos (IPE/USP), Brasil, v. 29, n. 3, p. 303-341, 1999.

NELSON, D. **Conditional heteroskedasticity in assets returns: A new approach**. Econometrica, v. 12, n. 2, p. 347-370, 1991.

OLIVEIRA, A. B.; ZIEGELMANN, F., A. **Um estudo comparativo de Redes Neurais e Modelos GARCH para Previsão da Volatilidade de Séries Temporais Financeiras**. 19º SINAPE, 2010, São Pedro-SP.

POON, S., & GRANGER, C. Forecasting volatility in financial markets: a review. **34 Journal of Economic Literature**, v. XLI, p. 478-539. 2003.

POTERBA, J, M.; SUMMERS, L. H. **Mean reversion in stock prices: evidence and implications**. NBER working paper series, n. 2343, 1987.

RODRIGUES, A, F. **A utilização de dados intradiários para a construção de modelos de previsão de volatilidade: uma comparação entre a variância realizada e a amplitude realizada**, 37p. Dissertação de Mestrado - COPPEAD/UFRJ, Rio de Janeiro, 2006.

SHIRYAEV, A. N. **Essentials of Stochastic Finance: Facts, Models, Theory**. Singapore: World Scientific Publishing Co. Pte. Ltd , 1999.

WANG, K. **Forecasting volatility in equity, bond and money markets: A market-based approach**. 21st Australasian Finance and banking conference 2008 paper, 2007.