

Tipos de variáveis e utilizações

Dado que a função de probabilidade é uma derivação da função t de student, ela é melhor adequada a variáveis contínuas, porém ela é mais fácil de se lidar quando temos 2 ou mais graus de liberdade, pois a sua variância deixa de ser infinita.

Na última década as variações da t-student chamaram muita atenção no estudo de mercado de ações, a não generalizada foi utilizada em alguns artigos, entre eles: models on international portfolio risk management (Ku, 2008); pricing of European options (Cassidy et al., 2010); models for insurance loss data (Brazauskas and Kleefeld, 2011); modeling of Brazilian stock returns (Bergmann and de Oliveira, 2013); modeling of stock returns in Nigeria (Shittu et al., 2014).

Em particular “modeling of Brazilian stock returns” o autor pontua que houveram trabalhos que comprovam empiricamente que esta distribuição é melhor adaptada no cenário de mercados de ações em períodos curtos, menores do que um mês, do que outras distribuições como a logística, a exponencial ou a Discreta misturada Normal, graças a ela ter um excesso de kurtosis positiva.

Referencias usadas nesta semana

http://dspace.cbe.ac.tz:8080/xmlui/bitstream/handle/123456789/248/IRJFE_ISSUE_108.pdf?sequence=1#page=28 Pag 28

<https://www.research.manchester.ac.uk/portal/files/78743532/studentt.pdf>