



Dipartimento di Economia

Università
Ca' Foscari
Venezia

Dipartimento di Economia – Università Ca' Foscari Venezia
Campus San Giobbe – Cannaregio 873, 30121 Venezia
P.IVA 00816350276 – CF 80007720271
www.unive.it/dip.economia

HiDEA

Progetto			
Advanced Econometrics for High-frequency Data			
Acronimo	HiDEA		
Durata	48 mesi		
Avvio	29/04/2020	Termine	29/04/2024
Finanziamento			
Responsabile scientifico	Loriana Pelizzon		
Area scientifica			
Abstract	HiDEA mira a sviluppare nuove idee teoriche nell'econometria dei dati ad alta frequenza e ad applicarle per risolvere problemi economici e finanziari. In particolare, i principali progressi teorici del progetto saranno: lo sviluppo dell'econometria dei prezzi stantii, l'econometria dei flash crash, l'econometria dei grandi sezioni trasversali. Le principali applicazioni saranno: • misurazione della liquidità del mercato dai prezzi delle transazioni, • studio delle implicazioni politiche per la prevenzione di mini flash crash non correlati ai fondamentali di mercato, • sfruttare il contenuto informativo nelle sezioni trasversali dei dati ad alta frequenza per analizzare il comportamento del mercato e per il monitoraggio del rischio sistemico, • comprendere il comportamento e il ruolo svolto trader ad alta frequenza nel processo di formazione dei prezzi.		
Budget Progetto	€ 97.00.00		
Budget UNIVE			