

soma dos pesos acumulados mais o da condição inicial tem que ser 1

peso implicado para a condição inicial

peso dado a cada observação passada

peso acum atual excet

lambda
0.94
períodos
200
peso vol. inicial
0.000004
soma pesos
1
precisão
0.9999
mín
149
meia vida
12

Ilustração da Dinâmica do EWMA

Essa planilha permite avaliar o peso dado a cada observação passada pelo modelo de alisamento exponencial EWMA de acordo com o valor do parâmetro de decaimento lambda. Além disso, calcula o número mínimo de observações para atingir uma precisão mínima requerida.

precisão exigida ao cortar a amostra no número de observações dado por #min

número de observaões necessárias para atingir a precisão requerida

número de períodos até que o efeito do choque na volatilidade produzido por uma observação dissipe à metade.

distancia	peso
1	0.060000
2	0.056400
3	0.053016
4	0.049835
5	0.046845
6	0.044034
7	0.041392
8	0.038909
9	0.036574
10	0.034380
11	0.032317
12	0.030378
13	0.028555
14	0.026842
15	0.025231
16	0.023718
17	0.022294
18	0.020957
19	0.019699
20	0.018517
21	0.017406
22	0.016362
23	0.015380
24	0.014457
25	0.013590
26	0.012775
27	0.012008
28	0.011288
29	0.010610
30	0.009974
31	0.009375
32	0.008813
33	0.008284
34	0.007787
35	0.007320
36	0.006881
37	0.006468
38	0.006080
39	0.005715
40	0.005372
41	0.005050
42	0.004747
43	0.004462
44	0.004194
45	0.003943
46	0.003706
47	0.003484
48	0.003275
49	0.003078

50	0.002893
51	0.002720
52	0.002557
53	0.002403
54	0.002259
55	0.002124
56	0.001996
57	0.001876
58	0.001764
59	0.001658
60	0.001558
61	0.001465
62	0.001377
63	0.001294
64	0.001217
65	0.001144
66	0.001075
67	0.001011
68	0.000950
69	0.000893
70	0.000839
71	0.000789
72	0.000742
73	0.000697
74	0.000655
75	0.000616
76	0.000579
77	0.000544
78	0.000512
79	0.000481
80	0.000452
81	0.000425
82	0.000399
83	0.000376
84	0.000353
85	0.000332
86	0.000312
87	0.000293
88	0.000276
89	0.000259
90	0.000244
91	0.000229
92	0.000215
93	0.000202
94	0.000190
95	0.000179
96	0.000168
97	0.000158
98	0.000148
99	0.000140
100	0.000131
101	0.000123
102	0.000116
103	0.000109

104	0.000102
105	0.000096
106	0.000090
107	0.000085
108	0.000080
109	0.000075
110	0.000071
111	0.000066
112	0.000062
113	0.000059
114	0.000055
115	0.000052
116	0.000049
117	0.000046
118	0.000043
119	0.000040
120	0.000038
121	0.000036
122	0.000034
123	0.000032
124	0.000030
125	0.000028
126	0.000026
127	0.000025
128	0.000023
129	0.000022
130	0.000020
131	0.000019
132	0.000018
133	0.000017
134	0.000016
135	0.000015
136	0.000014
137	0.000013
138	0.000012
139	0.000012
140	0.000011
141	0.000010
142	0.000010
143	0.000009
144	0.000009
145	0.000008
146	0.000008
147	0.000007
148	0.000007
149	0.000006
150	0.000006
151	0.000006
152	0.000005
153	0.000005
154	0.000005
155	0.000004
156	0.000004
157	0.000004

158	0.000004
159	0.000003
160	0.000003
161	0.000003
162	0.000003
163	0.000003
164	0.000003
165	0.000002
166	0.000002
167	0.000002
168	0.000002
169	0.000002
170	0.000002
171	0.000002
172	0.000002
173	0.000001
174	0.000001
175	0.000001
176	0.000001
177	0.000001
178	0.000001
179	0.000001
180	0.000001
181	0.000001
182	0.000001
183	0.000001
184	0.000001
185	0.000001
186	0.000001
187	0.000001
188	0.000001
189	0.000001
190	0.000001
191	0.000000
192	0.000000
193	0.000000
194	0.000000
195	0.000000
196	0.000000
197	0.000000
198	0.000000
199	0.000000
200	0.000000

--	--

--	--

--	--

--	--

--	--

--	--

--	--

--	--

--	--

--	--

--	--

--	--

--	--

--	--

--	--

ulado até a observação
o o da condição inicial

acumulado
0.999996
0.939996
0.883596
0.830580
0.780745
0.733900
0.689866
0.648473
0.609565
0.572991
0.538611
0.506294
0.475916
0.447361
0.420519
0.395288
0.371570
0.349276
0.328319
0.308619
0.290102
0.272696
0.256334
0.240953
0.226496
0.212906
0.200131
0.188123
0.176836
0.166225
0.156251
0.146876
0.138063
0.129779
0.121992
0.114672
0.107792
0.101324
0.095244
0.089529
0.084157
0.079108
0.074361
0.069899
0.065705
0.061762
0.058056
0.054573
0.051298

0.048220
0.045327
0.042607
0.040050
0.037647
0.035388
0.033264
0.031268
0.029392
0.027628
0.025970
0.024412
0.022947
0.021570
0.020275
0.019058
0.017915
0.016840
0.015829
0.014879
0.013986
0.013147
0.012357
0.011616
0.010919
0.010263
0.009647
0.009068
0.008524
0.008012
0.007531
0.007079
0.006654
0.006254
0.005879
0.005526
0.005194
0.004882
0.004589
0.004313
0.004054
0.003811
0.003582
0.003367
0.003165
0.002974
0.002796
0.002628
0.002470
0.002321
0.002182
0.002051
0.001927
0.001811

0.001703
0.001600
0.001504
0.001413
0.001328
0.001248
0.001173
0.001103
0.001036
0.000974
0.000915
0.000860
0.000808
0.000759
0.000714
0.000670
0.000630
0.000592
0.000556
0.000523
0.000491
0.000461
0.000433
0.000407
0.000382
0.000359
0.000337
0.000317
0.000298
0.000279
0.000262
0.000246
0.000231
0.000217
0.000204
0.000192
0.000180
0.000169
0.000158
0.000149
0.000139
0.000131
0.000123
0.000115
0.000108
0.000101
0.000095
0.000089
0.000083
0.000078
0.000073
0.000069
0.000064
0.000060

0.000056
0.000053
0.000049
0.000046
0.000043
0.000040
0.000037
0.000035
0.000033
0.000030
0.000028
0.000026
0.000025
0.000023
0.000021
0.000020
0.000018
0.000017
0.000016
0.000014
0.000013
0.000012
0.000011
0.000010
0.000009
0.000009
0.000008
0.000007
0.000006
0.000006
0.000005
0.000005
0.000004
0.000004
0.000003
0.000003
0.000002
0.000002
0.000002
0.000001
0.000001
0.000001
0.000000

