

Práctica de profundización sobre Regresión Robusta y Garch

Con el objetivo de profundizar en el conocimiento de las técnicas de Regresión Robusta y Predicción del Riesgo, se sugiere leer detenidamente el artículo “Intraday Volatility Prediction” de Garcia C, Martelli A, Rona L, Ta A. disponible en esta carpeta, con el objetivo de identificar las herramientas vistas en el curso de WA.

El challenge y los datos utilizados están disponibles en <https://challengedata.ens.fr/challenges/22>