A modell hatékonyságát a Mean Squared Error (MSE) alapján értékelhetjük. A MSE érték azt méri, hogy az előrejelzett értékek mennyire térnek el a valós értékektől. Minél alacsonyabb MSE 🡪 annál jobb a modell prediktív képessége.

A modellünkben egy lineáris regressziós modellt használunk, amely a négyzetes hozamok késleltetett értékeit használja a jövőbeli variancia előrejelzésére. Az algoritmus tanulási fázisban megtanulja a korábbi adatok alapján a kapcsolatot a késleltetett hozamok és a jövőbeli variancia között, majd ezután képes előrejelzéseket tenni a tesztadatokra.

Az MSE értékünk megfelelően alacsony volt, így elmondható, hogy jól teljesít a modell. A keresztvalidációt az adott kódban a cross\_val\_score függvény segítségével számoljuk ki és mentjük el a „score” változóba.