RCP 209 : prédiction de la volatilité des marchés financiers

Jerome Petit

1/13/2019

RCP 209 : prédiction de la volatilité des marchés financiers

Introduction

L’objectif de ce projet est de prédire la volatilité future à partir de la volatilité historique et de l’évolution des prix. L’intérêt de la prédiction de la volatilité sur les marché financier et de permettre un meilleur contrôle du risque. Afin de mener cette étude, nous allons utiliser des données fournis par le hedge fund CFM : <https://challengedata.ens.fr/en/challenge/34/volatility_prediction_in_financial_markets.html>

J’utiliserai également la métrique du challenge : MAPE.

Dans ce rapport, je présenterai les différentes méthodes de prédiction utilisées et comparerai les résultats obtenus par ses différentes méthodes

Les données

Le jeu de données