
VICKNESWARY TAGORE, University of Saskatchewan

Approches simples et efficaces d'estimation des modèles de volatilité stochastique

L'estimation des paramètres de modèles de volatilité stochastique standard possède une riche histoire. Parmi les approches existantes, les méthodes d'estimation généralisée des moments (MGM) et du quasi-maximum de vraisemblance sont très connues et couramment utilisées. Nous présentons une méthode simple des moments (MM) qui, contrairement à l'approche MGM existante, ne nécessite pas un nombre arbitrairement élevé de fonctions non biaisées des moments pour construire les équations d'estimation des moments des paramètres. De plus, nous examinons en détail la performance pour de petits échantillons de l'approche MM à l'aide d'une étude de simulation. Nous présentons aussi une autre approche simple généralisant l'approche basée sur la quasi-vraisemblance.