

V této práci se zkoumá chování kvantilové regrese neuronových sítí v odhadování kvantilů realizované volatility a kvantilů výnosů s výhledem více kroků. Závisí na realizované varianci a jejích komponentech (realizovaná variance, mediánová realizovaná variance, integrovaná variance, skoková variance a pozitivní a negativní semivariance). Použitá data jsou S&P 500 futures a WTI Crude Oil futures. Výsledné modely výnosů a volatility mají dobré absolutní chování a relativní chování v porovnání s modely ohodnocenými lineární kvantilovou regresí. V případě in-sample má lepší chování kvantilová regrese neuronových sítí a v případě out-of-sample mají chování stejně dobré.