

Дипломна робота: 123 с., 45 рис., 9 табл., 1 додаток, 20 джерел.

Об'єкт дослідження – нестационарні гетероскедастичні фінансово-економічні процеси.

Предмет дослідження – математичні моделі і методи опису гетероскедастичних процесів, оцінювання та аналіз якості прогнозів, а також моделі оцінювання ринкових ризиків.

Методи дослідження – теорія моделювання і прогнозування часових рядів, регресійний аналіз, статистичні методи аналізу фінансових ризиків.

Метою роботи є побудова адекватних моделей гетероскедастичних процесів для прогнозування волатильності та оцінювання ринкових ризиків за її допомогою.

В роботі проведено огляд основних підходів до оцінювання ринкових ризиків, розглянуто та проаналізовано метод оцінки VaR. Проведений огляд моделей та їх особливостей для опису динаміки волатильності та її прогнозування. Було проаналізовано результати моделювання та оцінювання за-для обґрунтованого вибору найкращої моделі для оцінки ринкових ризиків.

**РИНКОВИЙ РИЗИК, ВОЛАТИЛЬНІСТЬ, ПРОГНОЗУВАННЯ, VAR,  
УМОВНА АВТОРЕГРЕСІЙНА ГЕТЕРОСКЕДАСТИЧНІСТЬ**