

## АНОТАЦІЯ

Дипломна робота: 102 с., 26 рис., 6 табл., 2 додатки, 13 джерел.

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

Предмет дослідження – методології оцінювання ринкових ризиків та методи оцінювання якості прогнозів.

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

Метою роботи є проаналізувати предмет дослідження, дослідити ефективність існуючих традиційних методик прогнозування ринкового фінансового ризику Value at Risk – історичного методу та методу Монте-Карло та застосувати умовний модифікований алгоритм обчислення ризику Conditional Value at Risk.

В роботі проведено огляд основних підходів до оцінювання ринкових ризиків, розглянуто та проаналізовано метод оцінки VaR. Було проаналізовано результати моделювання та оцінювання за-для обґрунтованого вибору найкращої моделі для оцінки ринкових ризиків.

Створено інформаційну аналітичну систему для моделювання й прогнозування фінансово-економічних процесів на базі методологій VaR і CVaR та для оцінювання ризикової вартості за їх допомогою.

Система реалізована на мові програмування C#. Наведено приклади застосування програми для прогнозування та оцінювання ринкового ризику на реальних фінансових даних.

РИНКОВИЙ РИЗИК, ПРОГНОЗУВАННЯ, VAR, CVAR.