

РЕФЕРАТ

Звіт про НДР: 115 с., 15 табл., 37 рис., 1 дод., 34 джерела.

ГЕТЕРОСКЕДАСТИЧНІСТЬ, АВТОРЕГРЕСІЯ, МОДЕЛЮВАННЯ,
ПРОГНОЗУВАННЯ.

Об'єкт дослідження – гетероскедастичні фінансово-економічні процеси.

Мета дипломної роботи – аналіз основних моделей для опису гетероскедастичних фінансово-економічних процесів, огляд їх властивостей; побудова моделей для опису та прогнозування реальних фінансово-економічних даних, перевірка їх адекватності.

У роботі проведено аналіз існуючих моделей для опису гетероскедастичних фінансово-економічних процесів. Для реальних фінансових даних побудовані моделі ARCH та GARCH, проведено їх порівняння за рядом критеріїв.