

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

Факультет прикладной математики и информатики

Кафедра теории вероятностей и математической статистики

Аннотация к дипломной работе

**ИССЛЕДОВАНИЕ НЕКОТОРЫХ РАЗНОВИДНОСТЕЙ
МОДЕЛЕЙ GARCH**

Чернышёв Никита Сергеевич

Научный руководитель – профессор кафедры ТВиМС ФПМИ,
доктор физико-математических наук, Труш Николай Николаевич

2025

РЕФЕРАТ

Дипломная работа, 42 с., 3 табл., 8 рис., 28 источников

Ключевые слова: ВОЛАТИЛЬНОСТЬ, ПРОГНОЗИРОВАНИЕ, ARCH, GARCH, ДОХОДНОСТЬ, ВИЗУАЛИЗАЦИЯ ДАННЫХ.

Объект исследования: некоторые модели GARCH

Цель работы: анализ эффективности некоторых разновидностей моделей GARCH.

Методы исследования: методы математической статистики, программирование, визуализация данных.

Результат работы: отчет для визуального анализа некоторых разновидностей моделей GARCH.

Область применения результатов: инвестиционная деятельность.

РЭФЕРАТ

Дыпломная праца, 42 с., 3 табл., 8 мал., 28 крыніц

Ключавыя словы: ВАЛАЦІЛЬНАСЦЬ, ПРАГНАЗАВАННЕ, ARCH, GARCH, ПРЫБЫТКОВАСЦЬ, ВІЗУАЛІЗАЦЫЯ ДАДЗЕННЫХ.

Аб'ект даследавання: некаторыя мадэлі GARCH

Мэта працы: аналіз эфектыўнасці некаторых разнавіднасцяў мадэляў GARCH.

Метады даследавання: метады матэматычнай статыстыкі, праграмаванне, Візуалізацыя дадзеных.

Вынік працы: справаздача для візуальнага аналізу некаторых разнавіднасцяў мадэляў GARCH.

Вобласць прымянення вынікаў: інвестыцыйная дзейнасць.

ABSTRACT

Graduate work, 42 p., 3 tables, 8 figures, 28 sources

Keywords: VOLATILITY, PROGNOSING, ARCH, GARCH, VALUE, DATA VISUALIZATION.

Object of study: some GARCH models

Purpose of work: to analyze the effectiveness of some varieties of GARCH models.

Research methods: methods of mathematical statistics, programming, data visualization.

Result of work: report for visual analysis of some varieties of GARCH models.

Scope of the results: investment activity.