

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
Факультет прикладной математики и информатики
Кафедра теории вероятностей и математической статистики

Аннотация к дипломной работе
ИССЛЕДОВАНИЕ НЕКОТОРЫХ РАЗНОВИДНОСТЕЙ МОДЕЛЕЙ
GARCH

Иванов Алексей Андреевич

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

РЕФЕРАТ

Дипломная работа, 34 с., 1 табл., 6 рис., 28 источников

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

Объект исследования: прогнозирование временных рядов с помощью модели GARCH

Цель работы: оптимизация прогнозной модели

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, 34 с., 1 табл., 6 мал., 28 крыніц

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

Аб'ект даследавання: прагназаванне часавых шэрагаў з дапамогай мадэлі GARCH

Мэта працы: аптымізацыя прагнознай мадэлі

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, 34 p., 3 tables, 8 figures, 28 sources

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

Object of study: Time Series Forecasting Using GARCH Model

Purpose of work: optimization of the predictive model

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.