Аганин Артём Давидович Моделирование волатильности финансовых временных рядов при помощи многомерных GARCH и HAR моделей

ОГЛАВЛЕНИЕ ДИССЕРТАЦИИ

кандидат наук Аганин Артём Давидович

Оглавление

Введение

Глава 1. Сравнение методов моделирования волатильности

1.1 Сравниваемые модели

1.1.2. Семейство НАЯ-ЯУ моделей

1.1.3. ARFIMA модели

1.2. Методика сравнения

1.3. Результаты эмпирического сравнения 42 Глава 2. Что влияет на волатильность обменного курса

2.1. Обзор литературы

2.2. Модели оценки волатильности и влияния волатильности нефтяных цен на волатильность обменного курса

2.2.1. Одномерные GARCH модели

2.2.2. Двумерные GARCH модели

2.2.3. Реализованная волатильность

2.2.4. Модели зависимости волатильности

2.3. Данные

2.4. Оценки волатильности

2.5. Динамика коэффициента влияния в

2.6. Анализ влияния санкций и других факторов

Глава 3. Волатильность Российского фондового индекса: нефть и

санкции

3.1 Обзор литературы

3.2. Методика оценивания

3.3. Данные 92 3.4 Особенности оценивания регрессий

3.5. Оценки волатильности

3.6. Анализ влияния санкций и других факторов 98 3.7 Выводы

Заключение

Список литературы

Приложения

Введение