## 1. Теоретические моменты GARCH(1,1)

### 1.1 Модель GARCH(1,1)



### 1.2 Математическое ожидание GARCH(1,1)

### 1.3 Дисперсия GARCH(1,1)

*Здесь и далее мы предполагаем, что моменты вычисляются для достаточно больших значений и поэтому .*

### 1.4 Эксцесс GARCH(1,1)

## 2. Моменты для данных рынков

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | Данные | Теоретический момент | Нормальная Модель | СTS Модель | MTS Модель | KR Модель |
| Мат. Ожидание |  |  |  |  |  |  |
| Дисперсия |  |  |  |  |  |  |
| Асимметрия |  |  |  |  |  |  |
| Эксцесс |  |  |  |  |  |  |