**РЕФЕРАТ**

Курсовой проект, 16 с., 6 рис., 10 табл., 6 источников.

Исследование моделей GARCH c устойчивым распределением

Объект исследования – GARCH(1,1) модели.

Цель работы – построение GARCH (1,1) моделей с распределениями СTS, MTS, KR по реальным данным.

Методы исследования – методы теории вероятностей, математической статистики.

Результатом является модели для S&P500, Microsoft, McDonalds и оценка точности аппроксимации.

Областью применения является Финансовая математика, анализ процессов с дискретным временем.