ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ

НАЦИОНАЛЬНЫЙ ИССЛЕДОВАТЕЛЬСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ

«ВЫСШАЯ ШКОЛА ЭКОНОМИКИ»

**Факультет экономических наук**

**Образовательная программа "Статистическое моделирование и актуарные расчеты"**

##### **Новиков Лев Ильич**

***«Метод обнаружения структурных сдвигов в GARCH-моделях с помощью бутстрэпа»***

##### Выпускная квалификационная работа - МАГИСТЕРСКАЯ ДИССЕРТАЦИЯ

по направлению подготовки 38.04.01 Экономика

|  |  |
| --- | --- |
| **Рецензент**  **PhD, доцент, Департамент статистики**  **и анализа данных**  **Веретенникова Мария Александровна** | **Руководитель**  **доцент, к.э.н.**  **Фурманов Кирилл Константинович** |
|  | **Консультант**  **старший преподаватель, научный сотрудник Международной лаборатории стохастического анализа и его приложений**  **Борзых Дмитрий Александрович** |

**Москва 2020**