

ПРОГНОЗИРОВАНИЕ ВОЛАТИЛЬНОСТИ ФИНАНСОВЫХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ: АДАПТИВНЫЙ ПОДХОД

В.В. Давнис, А.Б. Тимченко

Предложен вариант модели Р. Ингла, в которой условно гетероскедастичные остатки прогнозируются с помощью адаптивной регрессии. Вычислительные эксперименты в соответствии с данным вариантом модели продемонстрировали значительное повышение точности предсказания уровня ожидаемой волатильности. Этот факт вызывает интерес и ориентирует на продолжение исследований в данном направлении.