

Název práce: Jednofaktorové modely úrokových sadziieb

Autor: Matúš Jambor

Katedra: Katedra pravdepodobnosti a matematické statistiky

Vedoucí bakalářské práce: RNDr. Petr Myška

Abstrakt:

V práci študujeme modely úrokových sadziieb, ktoré sa uplatňujú v oblasti finančnej matematiky a aktuárskych vied. Existuje niekoľko modelov, ktoré sa snažia čo najvierohodnejšie popísať správanie výnosovej krivky, pričom vo väčšine prípadov využívajú aparát z teórie pravdepodobnosti a náhodných procesov. Tieto modely slúžia taktiež na ocenenie finančných derivátov, ktorých cena sa odvíja od pohybov úrokových sadziieb. Zaoberáme sa tromi jednofaktorovými modelmi, ktoré bližšie predstavíme v druhej kapitole. V poslednej kapitole sa budeme venovať kalibrácii týchto modelov na reálne dáta.

Klíčová slova: jednofaktorové modely, úrokové sadzby, metóda maximálnej vierohodnosti