

Abstrakt

Cílem bakalářské práce je analýza vývoje trhu s credit default swapy a současné situace na něm. Práce by se dala rozdělit do tří částí. V úvodní části seznamuje čtenáře se základními pojmy, principy a klíčovými produkty. V další části se zabývá historickým vývojem credit default swapů, regulatorními kroky probíhajícími v posledních letech a změnami na trhu. Na závěr práce poukazuje na různé možnosti oceňování credit default swapů, a to buď pomocí Hull-White modelu, par asset swapu nebo lineární regrese. Práce si klade za cíl pomoci čtenáři se základní problematikou credit default swapů.

Klíčová slova Credit default swap, úvěrové riziko, úvěrová událost, centrální protistrana, asset swap spread

Délka práce 65 231