

Diplomová práce pojednává o modelech chování úrokových sazeb. V posledních desetiletích jich bylo několik vyvinuto, které se snaží co nejděrohodněji popsat chování výnosové křivky. Základní model byl vyvinut v roce 1977 Vašíčkem, na který následně navázali ostatní. Dnes již existuje velké množství modelů od těch nejjednodušší po ty nejkomplicovanější. Hlavním cílem diplomové práce je seznámit čtenáře nejenom se základním Vašíčkovým modelem, ale také s více sofistikovanými, jako například Brennan-Schwartzův či Longstaff-Schwartzův.