

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

Факультет прикладной математики и информатики

Кафедра теории вероятностей и математической статистики

Аннотация к дипломной работе

**«Аппроксимация временных структур при
использовании двухфакторных моделей
процентных ставок »**

Вигутова Виктория Вадимовна

Научный руководитель – профессор Г.А.Медведев

Минск, 2015

Реферат

Объем 56 с., 10 графиков, 1 рисунок, 11 источников. Дипломная работа состоит из введения, семи глав и заключения.

КРИВАЯ ДОХОДНОСТИ, АППРОКСИМАЦИЯ ВРЕМЕННЫХ СТРУКТУР, МОДЕЛЬ ЛОНГСТАФА-ШВАРЦА, МОДЕЛЬ ШЕФЕРА-ШВАРЦА.

Объект исследования – равновесный и арбитражный подходы моделирования временной структуры процентных ставок в непрерывном времени.

Цель работы — рассмотрение двухфакторных моделей равновесного и арбитражного подхода, а также их сравнение.

В дипломной работе рассмотрена двухфакторная модель равновесного подхода Лонгстафа-Шварца, двухфакторная модель арбитражного подхода Шефера-Шварца, показана работа этих моделей на реальных данных, а также показана актуальность использования равновесного подхода.

Abstract

Volume 56 p., 10 graphs, 1 figure, 11 sources. The thesis consists of an introduction, seven chapters and a conclusion.

YIELD CURVE, APPROXIMATION OF TERM STRUCTURES, LONGSTAFF-SCHWARZ MODEL, SCHWARZ-SCHAEFER MODEL.

Object of research – equilibrium and arbitrage approaches of modeling the term structure of interest rates in continuous time.

Purpose - consideration of two-factor model of equilibrium and arbitrage approaches, as well as their comparison.

The Longstaff and Schwarz two-factor equilibrium approach model and the Schaefer and Schwarz two-factor arbitrage approach model were considered in the thesis, the operation of these models on real data was shown, as well as the urgency of using the equilibrium approach.