

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ФАКУЛЬТЕТ ПРИКЛАДНОЙ МАТЕМАТИКИ И ИНФОРМАТИКИ
Кафедра теории вероятностей и математической статистики

Аннотация к дипломной работе

**«Потенциальная будущая подверженность кредитному
рisku и методы ее вычисления»**

Трубчик Сергей Николаевич

Научный руководитель – кандидат технических наук,
доцент В.В. Сечко

2017

РЕФЕРАТ

Дипломная работа, 53 страницы, 7 рисунков, 1 таблица, 12 источников, 1 приложение.

Ключевые слова: КРЕДИТНЫЙ РИСК КОНТРАГЕНТА, CVA, DVA, PFE, ДЕФОЛТ, НЕТТИНГ, ОБЕСПЕЧЕНИЕ, ДЕРИВАТИВ, ЭКСПОУЖА, ВНЕБИРЖЕВОЙ РЫНОК.

Объект исследования: кредитные риски.

Предмет исследования: методики расчета потенциальной будущей подверженности кредитному риску.

Цель работы: рассмотрение различных моделей, применяющихся для оценки будущей стоимости финансовых инструментов, получение формул для расчета стоимостей основных производных инструментов, вычисление величин кредитного риска.

Методы исследования: методы теории вероятностей, математической статистики, финансовой математики.

Результат: формулы для расчета стоимостей основных производных инструментов, расчеты величин кредитного риска.

Областью применения являются корпоративные финансы.

ABSTRACT

Graduate work, 53 pages, 7 figures, 1 table, 12 sources, 1 application.

Key words: COUNTERPARTY CREDIT RISK, CVA, DVA, DEFAULT, NETTING, COLLATERAL, DERIVATIVE, EXPOSURE, OVER-THE-COUNTER MARKET.

Object of study: credit risks.

Subject of study: methods of calculation potential future exposure.

Objective: review different models used for estimation future values of base derivatives, obtain formulas, and calculate values of credit risk.

Methods of research: methods of probability theory, mathematical statistics and finance mathematics.

Result: formulas for calculating present and future values of base derivatives, calculation of credit risk adjustments.

The field of application is the corporate finance.