

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ФАКУЛЬТЕТ ПРИКЛАДНОЙ МАТЕМАТИКИ И ИНФОРМАТИКИ

Кафедра теории вероятностей и математической статистики

Аннотация к дипломной работе

**«Прогнозирование финансовых рисков и потери при их
осуществлении»**

Кислач Михаил Игоревич

Научный руководитель – доктор физико-математических наук,
профессор Г.А. Медведев

2017

РЕФЕРАТ

Дипломная работа: страниц 55, рисунков 4, таблиц 6, приложений 1, источников 4.

Ключевые слова: рыночный риск, аффинные модели, оценка параметров.

Объект исследования: рыночный риск в аффинных моделях.

Цель работы: построение оценок параметров аффинных моделей и расчет рыночной цены риска для реальных данных.

Методы исследования: метод максимального правдоподобия и методы решение матричных уравнений.

Полученные результаты могут быть использованы в учебных и научных целях, также в финансовом анализе.

ABSTRACT

Graduate work: pages 55, pictures 4, tables 6, applications 1, sources 4.

Key words: market risk, affine models, estimation of parameters.

The object of investigation: market risk in affine models.

The aim of the work: construction estimates of the parameters of affine models and calculating market price of risk for real data.

Research methods: maximum likelihood estimation and methods for solving matrix equations.

The results obtained can be used for educational and scientific purposes, they also can be used in financial analysis.