

Časová štruktúra úrokových mier: rôzne prístupy a typy

- Časová štruktúra úrokových mier poskytuje dôležité informácie o vývoji na finančnom trhu
- Cieľom bakalárskej práce bude pochopiť rôzne prístupy k jej konštrukcii, konkrétne metódu splajnov a Nelson-Siegel metódu, ich výhody a nevýhody.
- Súčasťou práce bude aplikácia naštudovaných metód na reálnych dátach

Užitočné informácie

- Literatúra:
 - Nelson, Siegel, Andrew (1987)
 - Filipovic: Estimating term structure
- Predpoklady: programovanie v R (alebo v inom softwéri), práca s dátami
- Možnosť pokračovať na diplomovej práci so zložitejšími modelmi úrokových mier