

SZEMINÁRIUM

Az ELTE TTK Valószínűségelméleti és Statisztika Tanszékének
szemináriumán 2015. június 19-én, pénteken 10 órakor

Süli Balázs Márton (ELTE TTK Valószínűségelméleti és Statisztika
Tanszék)

Hozamgörbe-modellezés

címmel tart előadást.

Az előadás helye: ELTE lágymányosi campus, déli épület (1117 Budapest,
Pázmány Péter s. 1/C), 3-316.

Kivonat: A hozamgörbe-modellezéshez kapcsolódó legfontosabb fogalmak és elterjedt módszerek felidézése, mint például a spline vagy a Nelson-Siegel-Svensson modellcsalád. A Python környezetben megírt algoritmusok ismertetése. Valós 6000 kötvényt átfogó Bloomberg adatokra való alkalmazás eredményeinek bemutatása, módszerek összehasonlítása. Konklúzió és további érdekes lehetőségek a témában.