

# Стохастические процессы рыночной цены риска

Руководитель:  
Профессор Медведев Г.А.

- Проблема оценивания и определения процессов рыночной цены риска является одной из перспективных тем для исследования в области оценивания финансовых активов

# Поставленные задачи

- Изучить существующие методы оценивания РЦР
- Обобщить существующие данные о рыночной цене риска
- Связать РЦР с ценообразующим ядром.
- По возможности построить простую в реализации модель оценивания РЦР.

# Объект исследования

- Рыночная цена риска
- Ценообразующее ядро

# Предмет исследования

- Стохастические процессы рыночной цены риска
- Связь между ценой риска и ценообразующим ядром
- Оценивание рыночной цены риска

# Гипотеза

- Рыночная цена риска функциональна связана с ценообразующим ядром

# Основные результаты

- Изучена разнообразная литература описывающая рыночную цену риска
- Произведены изыскания в области оценивания рыночной цены риска
- Ознакомление с понятием ценообразующего ядра

# Новизна работы

- В моей работе будет изучена связь между ценообразующим ядром и рыночной ценой риска, что является еще мало изученной областью в оценивании финансовых активов и их параметров.



**Спасибо за внимание**