

ФОРМУЛЫ ОЦЕНКИ ОБРАТНОГО РАСПРЕДЕЛЕНИЯ УБЫТКА ПРОМЫШЛЕННЫХ ПРЕДПРИЯТИЙ

Стихова О.В.

ФГБОУ ВО Московский государственный технологический университет «СТАНКИН»,
каф. «Прикладная математика», Россия, 127055, г. Москва, Вадковский пер.
д.1а, Тел.(499)972-95-20, E-mail:olgitast2011@mail.ru

Значимые CDS-индекс транши согласно распределению позволяют продавцам страховки от кредитного риска принимать потенциальные убытки долями. Массовые дефолты возможны при возникновении каких-либо влияющих на состояние дефолта макроэкономических показателей, таких, как общее состояние промышленного сектора, отраслевой или региональный фактор [1]. В работе рассмотрен новый комплекс задач построения адекватной модели оценки для компаний производственного сектора [2]. Многопараметрическая модель обратного распределения учитывает различные смешанные распределения. Популярность кредитных производных и общеизвестных синтетических индексов возросла в последнее время. Проведены вычисления частей транша на вторичном рынке обязательств. Для решения задачи оценки использованы одновременно несколько копул, чтобы получить GH-копулу с учетом независимости границ и хвостов. В отличие от применяемых ранее моделей, данные формулы оценки позволяют производить расчет траншей промышленных производных бумаг [3]. Проведены серия вычислительных экспериментов по моделированию для промышленных предприятий как на искусственно сгенерированных выборках, так и с использованием реальных данных и верификация результатов.

Литература

1. Стихова О.В. Математические методы и модели оценивания риска по траншам производных ценных бумаг промышленных компаний. / Третья Международная научная конференция «Моделирование нелинейных процессов и систем». Сборник тезисов. М.:Янус-К,2015 год, стр.164-165.
2. Щетинин Е.Ю, Стихова О.В. Математическое моделирование производных ценных бумаг на дефолт по кредиту на основе моделей копул. / Научно-практический и информационно-аналитический сборник «Финансовая аналитика: проблемы и решения», «Издательский дом ФИНАНСЫ и КРЕДИТ», 7(49)-2011,стр.16-25.
3. Стихова О.В. Математическое моделирование поведения кредитных деривативов. /XLII Всероссийская конференция по проблемам математики, информатики, физики и химии. Тезисы докладов. Секция «Прикладная теория вероятностей и теоретическая информатика».-М: Изд-во РУДН, 2009, стр.123-124.