

Model vasicek untuk pergerakan tingkat bunga spot.

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20180273&lokasi=lokal>

Abstrak

Tugas akhir ini secara umum bertujuan menjelaskan model Vasicek tentang pergerakan tingkat bunga spot. Dalam pandangan Vasicek, pergerakan tingkat bunga spot dari waktu ke waktu dipandang sebagai suatu proses stokastik waktu kontinu dan ruang keadaan kontinu, pergerakan tingkat bunga dianggap memiliki sifat mean reversion, dan gejolak perubahan tingkat bunga dari waktu ke waktu dijelaskan oleh unsur ketidakpastian Brownian motion. Berdasarkan kajian pada model vasicek tentang pergerakan tingkat bunga, didapatkan penjelasan bahwa tingkat bunga untuk suatu waktu tertentu di masa depan terdistribusi Normal dengan rata-rata dan variansi tertentu. Simulasi dilakukan terhadap model Vasicek untuk mendeskripsikan ciri khas pergerakan tingkat bunga spot menurut model Vasicek.