

TFM (Trabajo Fin de Máster) del TECI

Curso académico: 2014-2015

Título: Modeling term structure of gold: the dynamics of gold leasing market.

Tipo (marca una casilla): Académico ☐ Profesional ☒

Institución: Arfima Trading S.L.

Persona: Juan Toro

Ponente (si procede):

Observación:

Al rellenar los siguientes puntos hay que considerar que la carga de trabajo no debe superar las 300 horas para el estudiante

Problema a tratar:

We propose joint modeling of spot price of gold, convenience yield together (*Sharwtz*) with a affine two factor model for the interest rate. Kalman Filtering estimation is suggested and data sample extended for last 10 years.

Objetivos:

Our result would like to explain dynamics of gold leasing market