

TFM (Trabajo Fin de Máster) del TECI

Curso académico: 2014-2015

Título: Forecasting the term structure of swap spreads.

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 a quantitative horse race to measure the out-of-sample forecasting power of the swap spread curve using recognized term structure models (see Diebold and Li 2006).

Objetivos:

The main goal is to improve the understanding of the dynamics of the swap spread curve.