

ОТЗВЫВ
на выпускную квалификационную работу обучающегося СПбГУ
Ладиной Татьяны Дмитриевны
по теме «Разработка пакета программ «Финансовое моделирование»: анализ
финансовых инструментов»

Работа Т.Д. Ладиной посвящена разработке раздела «Анализ финансовых инструментов» пакета программ «Финансовое моделирование», создаваемого под руководством научного руководителя для различных курсов по финансам.

Актуальность предложенной научным руководителем темы работы связана с тем, что в наше время для полноценного преподавания финансовых курсов требуется специальное программное обеспечение (пакет). Однако такой пакет отсутствует даже у одного из самых популярных в мире учебников по финансовому моделированию Р. Брейли и С. Майерса «Принципы корпоративных финансов», шестнадцатое (!) издание которого появилось в 2017 г. Разумеется, имеется коммерческое ПО, но оно весьма дорого (минимальная цена около \$500).

Созданный Т.Д. Ладиной раздел включает следующие модули: процентные вычисления, позиционные диаграммы, биномиальная модель оценки опционов и модель Блэка-Шоулза. Уникальным является модуль, посвящённый биномиальной модели, так в нем реализованы продвинутое варианты этой модели (с учетом выплат дивидендов), которые не вошли даже в магистерский учебник К. Халла [4]. Для этого пришлось разобрать и обобщить теоретический материал из статей [6, 8].

Считаю, что работа Ладиной Т.Д. удовлетворяет всем требованиям, предъявляемым к выпускным квалификационным работам, и заслуживает оценку «отлично».

«30» мая 2017 г.

Подпись

Бухвалова Вера Вацлавовна
ФИО