

Отзыв на выпускную квалификационную работу

Царьков Никита Владимирович

«Моделирование структурных продуктов типа «Автоколл»

Выпускная квалификационная работа Никиты Владимировича посвящена изучению современного и недостаточно изученного финансового инструмента, такого как структурные продукты.

Структурные продукты многие банки позиционируют как альтернативу портфелям акций. Они представляют собой комбинацию различных финансовых инструментов и при этом имеют очень важное достоинство – возможность снизить риск и, кроме того, сохранить доходность на достаточно приемлемом уровне. В данной работе исследование проводится для структурного продукта типа «Автоколл». Такие структурные продукты имеют ключевую особенность – возможность досрочного погашения при определённых рыночных условиях.

Целью данной работы является разработка программного продукта, предназначенного для оценки теоретической стоимости и доходности структурных продуктов вида «Автоколл». Для достижения поставленной цели Никита Владимирович самостоятельно разработал модель расчетов стоимости и доходности структурных продуктов вида «Автоколл».

Для оценки теоретической стоимости структурного продукта в работе используется подход, связанный с моделированием методом Монте-Карло. Вычисление подобных оценок необходимо для определения целесообразности инвестирования в структурный продукт. При написании работы был создан программный продукт - калькулятор доходности и стоимости структурного продукта на языке Python.

Считаю, что Никита Владимирович блестяще справился с поставленной задачей. Тема исследования является актуальной и важной, структура и содержание работы соответствует заявленной теме. Прделанная работа подтверждает квалификацию бакалавра в применении современных методов анализа данных и владения средствами вычислительной техники.

В процессе обучения в бакалавриате Никита Владимирович проявил высокое усердие и трудолюбие.

Результаты работы соответствуют требованиям, предъявляемым к выпускной квалификационной работе бакалавра, и работа Никиты Владимировича Царькова заслуживает оценки «отлично».

Научный руководитель,
доцент, к.ф.-м.н. Панкратова Я.Б.
04.06.2021

A handwritten signature in purple ink, appearing to read 'Я.Б. Панкратова', written in a cursive style.