

РЕЦЕНЗИЯ

на выпускную квалификационную работу
Войцеховской Виктории Анатольевны
«Оценка стоимости европейского опциона методом Монте-Карло»,
представленную на присвоение квалификации бакалавра
по направлению 010300
Фундаментальная информатика и информационные технологии

Современное состояние международных финансовых рынков характеризуется как большим количеством используемых деривативов, так и сложностью их поведения, что существенно усложняет составление прогнозов. Появление математических методов прогнозирования и технических средств обработки входных данных призвано обеспечить приемлемое качество прогнозов. В связи с этим работа В.А. Войцеховской, посвященная рассмотрению вопросов применения методов финансовой математики к оценке стоимости опционов, несомненно, актуальна.

Автор проводит анализ алгоритмов расчета опционов не только в стандартном пакете MatLab, но и на современных высокопроизводительных гибридных системах. В итоге ею получены весьма значимые конкретные количественные результаты от применения выбранных методов ускорения вычислений путем распараллеливания процессов.

В качестве достоинств представленной работы можно признать не только актуальность тематики проведенного исследования и его практическую значимость, но и тщательный анализ, и глубокое понимание автором сути решаемой задачи, а также применение ею передовых средств и пакетов разработки прикладного программного обеспечения.

Недостатком работы можно признать то, что в качестве исходных данных используются значения генератора случайных чисел, а не выборки реальных биржевых данных, и при этом не рассмотрены условия, допущения и ограничения для такой замены.

Несмотря на отмеченные недостатки, соискатель успешно решила поставленные методические и технические проблемы и выработала практические рекомендации для работы трейдеров на реальных рынках.

Считаю, что рецензируемая работа заслуживает оценки «отлично», а автор достойна присвоения квалификации бакалавра по направлению 010300 Фундаментальная информатика и информационные технологии.

Генеральный директор ООО «Ассоциация цифровых сервисов»
К.т.н., доцент



В.П.Руковчук