



ФЕДЕРАЛЬНАЯ СЛУЖБА
ПО ИНТЕЛЛЕКТУАЛЬНОЙ СОБСТВЕННОСТИ

ГОСУДАРСТВЕННАЯ РЕГИСТРАЦИЯ ПРОГРАММЫ ДЛЯ ЭВМ

Номер регистрации (свидетельства):
2018664736

Дата регистрации: 21.11.2018

Номер и дата поступления заявки:
2018662817 06.11.2018

Дата публикации и номер бюллетеня:
21.11.2018 Бюл. № 12

Контактные реквизиты:
okudr@mail.ru

Автор(ы):

Кудрявцев Олег Евгеньевич (RU)

Правообладатель(и):

Кудрявцев Олег Евгеньевич (RU)

Название программы для ЭВМ:

Программа "Lookback Option Pricer"

Реферат:

Программа предназначена для вычисления цен опционов Lookback с фиксированной ценой исполнения в реалистичных моделях финансового рынка. Для заданного набора цен базового актива и выбранных параметров модели и опциона программой обеспечивается одновременное вычисление цен опционов. Управляя параметрами алгоритма, пользователь может достичь требуемого уровня погрешностей вычислений.

Язык программирования: C/C++

Объем программы для ЭВМ: 6350 Кб