

Рецензия на выпускную квалификационную работу

Студент ОП «Экономика»: Гимадиев Азат

Научный руководитель: Демешев Борис Борисович

Тема: Прогнозирование стоимости опционов с помощью моделей краткосрочных процентных ставок

Работа Азата посвящена прогнозированию цены опционов. В названии заявлено использование моделей краткосрочных процентных ставок, но до этих моделей, к сожалению, в работе дело не доходит. Азат прогнозирует цену опциона в рамках наивных предположений о динамике цены акции.

Плюсы работы. С одной стороны Азат разобрался в базовых теоретических моделях оценивания опционов. Несмотря на некоторые мелкие неточности в описании модели, в целом видно, что Азат разобрался с моделью Блэка-Шоулса. С другой стороны, Азат работает с реальными данными и демонстрирует умение обработать сырые данные и реализовать алгоритм прогнозирования на языке python.

Минусы работы. Работа состоит из отдельных кусков: блок теории и почти не связанный практический блок с прогнозами для четырех опционов на разные акции. Изложение трудно назвать аккуратным, но грубых ошибок нет. Также остались нереализованными прогнозы с моделированием динамики процентных ставок.

Трудно оценивать работу студента другого факультета, поскольку нет возможности выбрать точку отсчёта. По меркам факультета экономики работа Азата заслуживает удовлетворительную или хорошую оценку.

16 июня 2017

Демешев Борис Борисович
