

Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики»

Факультет математики

Отзыв научного руководителя на курсовую работу/ВКР

Студента(ки) __ Гимадиев Азат Фарсилович __ ,
Фамилия, имя, отчество

__ 3 __ курса, факультета __ математики __

на тему: «__ Прогнозирование стоимости опционов с помощью моделей краткосрочных процентных ставок __»

Оценка научного руководителя (по 10-балльной шкале)	5 (удовлетворительно)
--	------------------------------

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.

Комментарии к оценке:

Научный руководитель
ученая степень, звание,
кафедра (место работы)

департамент прикладной
экономики



Подпись

Демешев Б.Б.

И.О. Фамилия

«__ 16 __» __ июня __ 2017 __ г