**Белорусский государственный университет
Экономический факультет
Кафедра аналитической экономики и эконометрики**

**Аннотация к дипломной работе «Метод Монте-Карло и его применение в
финансовых моделях»»**

**Парфианович Владимир Георгиевич, научный руководитель:
Дубатовская Марина Валерьевна**

2014 г.

АННОТАЦИЯ

на дипломную работу
«Метод Монте-Карло и его применение в финансовых моделях»

Дипломная работа посвящена вопросам применения метода Монте-Карло в области финансов. В работе рассматривается математическое обоснование метода, его применение в области корпоративных финансов и для оценки производных финансовых инструментов.

В отличие от других немногочисленных исследований, в данной работе особое внимание уделяется практическим аспектам использования метода. На основе построенных финансовых моделей показаны возможности использования метода Монте-Карло для оценки привлекательности инвестиционного проекта, вычисления стоимости компании и цены ее акций, а также определения стоимости экзотических опционов.

Автор работы подтверждает, что приведенный в ней расчетно-аналитический материал правильно и объективно отражает состояние исследуемого процесса, а все заимствованные из литературных и других источников теоретические, методологические положения и концепции сопровождаются ссылками на их авторов.

ANNOTATION

To the Graduation Thesis

MONTE CARLO METHOD AND ITS APPLICATION IN FINANCIAL MODELS

This thesis is devoted to the application of the Monte Carlo method in the field of finance. The paper presents a mathematical justification of the method, its application in the field of corporate finance and valuation of derivatives.

Unlike other few studies this thesis focuses on the practical aspects of the method. Constructed financial models show the possibility of using the Monte Carlo method for evaluating the attractiveness of the investment project, calculate the cost of company and the price of its shares, as well as determining the value of exotic options.

The author of the thesis confirms that the work submitted features exact computational and analytical data that illustrate the state of the studied process with no bias; all theoretical and methodological provisions and concept mentioned and explained in the thesis are followed by citations and references to sources.