

**МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ**  
**БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ**  
**ФАКУЛЬТЕТ ПРИКЛАДНОЙ МАТЕМАТИКИ И ИНФОРМАТИКИ**  
**Кафедра теории вероятностей и математической статистики**

Аннотация к дипломной работе

**РАСЧЁТ ОПЦИОНОВ ЕВРОПЕЙСКОГО ТИПА  
ПРИ АБСОЛЮТНОМ КРИТЕРИИ**

Шульган Михаил Васильевич

Научный руководитель – кандидат физ.-мат. наук,  
доцент Н.М. Зуев

Минск, 2017

## РЕФЕРАТ

Дипломная работа, 37с.,4 рис., 6 источников

Ключевые слова: ОПЦИОН, АБСОЛЮТНЫЙ КРИТЕРИЙ, ЕВРОПЕЙСКИЕ ОПЦИОНЫ, АЗИАТСКИЕ ОПЦИОНЫ

Объект исследования – колл-опционы европейского типа, колл-опционы азиатского типа.

Цель работы: получение метода расчета опционов европейского и азиатского типа при абсолютном критерии, расчет стоимости опционов полученным методом.

Основные методы исследования: методы теории вероятностей, математической статистики.

Результаты работы: получены формулы для расчета европейских и азиатских опционов при абсолютном критерии, создано приложение для расчета опционов.

## **ABSTRACT**

Graduate work, 37 p., 4 pic., 6 sources

Key words: OPTION, ABSOLUTE CRITERIA, EUROPEAN OPTION, ASIAN OPTION

Object of research – European call options, Asian call options.

The aim of the work is to obtain a method of European and Asian option calculation and to calculate option prices by this method.

Basic research methods are methods of probability theory, mathematical statistics.

Results of work are obtained formulas for European and Asian option calculation with absolute criteria, the calculation program.