

**БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ**

**Факультет прикладной математики и информатики**

**Кафедра теории вероятностей и математической статистики**

Аннотация к дипломной работе

**Расчет опционов европейского и американского типов на неполных  
рынках**

Матюшенко Сергей Александрович

Научный руководитель – кандидат физико-математических наук, доцент Н.М.  
Зуев

**Минск 2021**

## Реферат

Дипломная работа, 73 страниц, 3 таблицы, 34 рисунков, 6 источников, 1 приложение.

Ключевые слова: ОПЦИОН, ХЕДЖИРОВАНИЕ, НЕПОЛНЫЕ РЫНКИ, МОДЕЛЬ, МЕТОД.

*Объект исследования* – опционы.

*Цель работы* - рассмотрение популярных методов для расчета опционов.

В ходе работы рассматриваются пять методов для расчета опционов.

Результатом является программная реализация методов расчета опционов на полных и неполных рынках.

Областью применения являются рынки ценных бумаг и инвестиционная деятельность.

## **Abstract**

Diploma work, 73 pages, 34 tables, 3 drawings, 6 sources, 1 annex.

Key words: OPTION, HEDGE, INCOMPLETE MARKENS, MODEL, METHOD.

*The object* of the study is options.

*The purpose* of the work is review of popular methods for calculation options.

*In the course* of the work, five methods for calculation options are considered.

*The result* is a software implementation of options calculation methods in full and incomplete markets.

The area of application is the securities markets and investment activities.