

ОТЗЫВ

на автореферат диссертации Данилюк Елены Юрьевны
«Обработка данных финансового рынка и
принятие решения о структуре Европейского опциона»,
представленной к защите на соискание ученой степени
кандидата физико-математических наук
по специальности 05.13.01 - Системный анализ,
управление и обработка информации

В диссертации Е.Ю. Данилюк проведено исчерпывающее аналитическое исследование стандартного и экзотического опциона купли и продажи Европейского стиля с гарантированным доходом держателя опциона и ограничением выплат продавца при заданной (меньше 1) вероятности успешного хеджирования, а также барьерного опциона купли и продажи с уступкой, функция выплат которого представляет собой описанный выше экзотический опцион, в случае суперхеджирования. Решены задачи построения оптимального хеджа и капитала двойного барьерного опциона купли и продажи, решена также задача оценивания двойного барьерного опциона в условиях совершенного хеджирования. Результаты исследований могут быть использованы в предложенном автором алгоритме обработки данных финансового рынка для принятий решения о структуре биржевого или внебиржевого опционного контракта.

Следует отметить исчерпывающую полноту и завершенность решения автором поставленных задач. Отмечу также грамотное и связное изложение результатов работы в автореферате.

Из автореферата следует, что автор свободно владеет аппаратом теории вероятностей, теории случайных процессов, теории стохастической финансовой математики.

Замечание. В автореферате говорится, что рассмотренные в диссертации экзотические опционы дороже стандартных опционов, однако не уточняется, справедливо ли это всегда или при определенных ограничениях, накладываемых на параметры опционных контрактов.

В целом же из автореферата следует, что автором диссертации решена задача, имеющая важное теоретическое и практическое значение, решена

вполне грамотно с использованием математических средств теории вероятностей и случайных процессов, математического, системного анализа, стохастической финансовой математики и компьютерного моделирования.

Представленные в автореферате исследования в достаточной степени апробированы и в достаточной мере отражены в публикациях, список которых в автореферате приведен.

Резюмируя вышесказанное, можно сделать вывод, что автор диссертации Е.Ю. Данилюк заслуживает присвоения ей ученой степени кандидата физико-математических наук по специальности 05.13.01 – Системный анализ, управление и обработка информации.

Доцент кафедры прикладной информатики и теории вероятностей
Российского университета дружбы народов,
кандидат физико-математических наук,
доцент

Ю.В. Гайдамака

Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования «Российский университет дружбы народов»

Адрес: 117198, г. Москва, ул. Миклухо-Маклая, д. 6

Тел.: +7 (495) 955 0999

E-mail: ygaidamaka@sci.pfu.edu.ru

«26» января 2015 г.

Подпись Гайдамака Юлии Васильевны

Заверяю:

Ученый секретарь

ФГАОУ ВО «Российский университет дружбы народов»,

доктор физико-математических наук,

профессор



В.М. Савчин