

ИУЦТ. Расчет рисков на рынке ценных бумаг

Ожидаемые сроки исполнения:

1 учебный семестр

Заказчик

-

2024



Контекст

В какой области решаем проблему?



биномиальная одношаговая модель



Проблема

Что за проблема: кто пытается достичь какую цель и что мешает?

Кто?

Альтенская Анастасия Валерьевна, главный специалист отдела "Цифровой аналитики" Площадка "Цифра -брокер"

Что хочет?

позволит на 30 % увеличить скорость наполнения базового портфеля ценных бумаг

Что мешает?

не может из -за сложности применяемых моделей и множестве входных параметров

Какие есть способы решения и почему они не подходят?

В отличие от используемых моделей позволяет более наглядно и просто смоделировать изменение стоимости ценных бумаг на фондовом рынке

