

АНОТАЦІЯ

Дана дипломна робота присвячена калібруванню фінансових моделей із застосуванням автоматичного диференціювання.

Метою роботи є створення підсистеми, яка буде виконувати калібрування фінансових моделей із застосуванням різних методів чисельного диференціювання.

У рамках дипломної роботи проведено аналіз існуючих методів чисельного диференціювання та проаналізовано їх точність і швидкодію.

У даній роботі як фінансові моделі використовуються дисконтна облігація з процентною ставкою, що накопичується неперервно чи дискретно.

Розроблена підсистема може використовуватись для калібрування інших моделей та є актуальною для компаній, які працюють на вторинному ринку цінних паперів.

Робота виконана на 47 аркушах, містить посилання на список використаних літературних джерел з 9 найменувань. У роботі наведено 3 рисунки, 2 таблиці та 2 додатки.

Ключові слова: чисельне диференціювання, швидкодія, фінансові моделі, бібліотека.