



ФЕДЕРАЛЬНАЯ СЛУЖБА
ПО ИНТЕЛЛЕКТУАЛЬНОЙ СОБСТВЕННОСТИ
ГОСУДАРСТВЕННАЯ РЕГИСТРАЦИЯ ПРОГРАММЫ ДЛЯ ЭВМ

Номер регистрации (свидетельства):
2025611447

Дата регистрации: 20.01.2025

Номер и дата поступления заявки:
2024692900 31.12.2024

Дата публикации и номер бюллетеня:
20.01.2025 Бюл. № 1

Автор(ы):

Кудрявцев Олег Евгеньевич (RU),
Алымова Елена Владимировна (RU),
Гречко Александр Сергеевич (RU),
Данилова Наталья Викторовна (RU)

Правообладатель(и):

Кудрявцев Олег Евгеньевич (RU)

Название программы для ЭВМ:

Программа вычисления цен опционов в моделях Леви с помощью гибридных численных методов

Реферат:

Программа предназначена для вычисления цен опционов в моделях Леви с помощью гибридных численных методов, комбинирующими применение традиционных численных методов и искусственные нейросети. В расчетах используется широкий класс математических моделей, допускающих скачки и/или стохастическую волатильность. В частности, реализованы гибридный метод факторизации Винера-Хопфа с помощью импульсных нейросетей, вычисление специального вида интегральных операторов типа свертки, методы решения уравнения для цены опциона в модели Хестона для вычисления цен барьерных опционов.

Язык программирования: Python

Объем программы для ЭВМ: 60 КБ