

**ОТЗЫВ НАУЧНОГО РУКОВОДИТЕЛЯ
о выпускной квалификационной работе обучающегося СПбГУ
Анастасии Александровны Миллер
по теме «Имитационная модель американского опциона»**

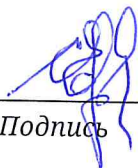
Выпускная квалификационная работа студентки А.А.Миллер полностью соответствует поставленной задаче, раскрывает заявленную тему, является актуальной и обоснованной.

Работа посвящена решению трудной задачи. Потребовалось изучить современную литературу в значительном объёме и провести ряд численных экспериментов. Некоторые направления исследований оказались не перспективными и корректное истолкование численных результатов было найдено не сразу. Однако в результате был получен ответ на поставленный вопрос о возможности применения метода квази Монте Карло и даже намечен некоторый новый подход к решению задачи. При этом А.А.Миллер проявила самостоятельность и изобретательность.

Считаю, что после проведения некоторых дополнительных численных экспериментов результаты могут быть опубликованы, а работа в представленном виде заслуживает оценки ОТЛИЧНО.

Научный руководитель,

д.ф.-м.н., профессор Ермаков С.М.



Подпись

« 30 » мая 2017 г.