Отзыв научного руководителя

на выпускную квалификационную работу студентки 4 курса бакалавриата

Миллер Анастасии Александровны, выполненную на тему «Имитационная модель американских опционов»

Задача работы состояла в следующем:

* изучить имитационные методы расчёта американского (бермудского) опциона,
* для алгоритмов, сложность которых растёт экспоненциально со временем, попытаться указать менее сложные аналоги (например, путём рандомизации),
* проиллюстрировать полученные результаты вычислительными примерами.

Задача решена полностью. На основе аналогий с методами Монте-Карло для решения интегральных уравнений с полиномиальный нелинейностью указаны методы рандомизация, снижающие трудоёмкость алгоритма. Приведённые вычисления убедительно иллюстрируют полученный результат, который является новым и представляет несомненный интерес.

Работа заслуживает оценки «отлично».

Научный руководитель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ /д.ф.-м.н., профессор С.М.Ермаков/