

# Сертификат

Ширяева  
Софья Игоревна

Россия, Федеральная территория «Сириус»,  
Научно-технологический университет «Сириус»

7—18 октября 2024 года приняла участие в  
научно-практическом интенсиве по  
воспроизведению state-of-the-art научных  
результатов

Федеральная территория «Сириус», Научно-  
технологический университет «Сириус»

Научно-практический интенсив по  
воспроизведению state-of-the-art научных  
результатов — бесплатная программа для тех,  
кто интересуется машинным обучением,  
построением архитектур нейронных сетей,  
систем хранения и обработки данных.



Яндекс Образование

---

## Программа

Лекции о современных научных и инженерных достижениях в IT-сфере.

Командная работа над проектами по воспроизведению экспериментов из научных статей:

- Постановка эксперимента и работа с данными
- Программная реализация эксперимента
- Обсуждение выводов об устойчивости экспериментов
- Презентация результатов

---

## Проектная работа

Обучение с подкреплением для решения задачи оптимального исполнения биржевых заявок в условиях изменяющейся ликвидности актива

В рамках проекта задача по реализации на бирже большого объёма актива решена методами машинного обучения с подкреплением для усложнённой модели арифметического броуновского движения с функциями рыночного влияния, зависящими от времени. Затем это решение сравнили с классическими решениями TWAP, Almgren-Chriss. Работа над проектом выполнялась в команде.