

Приложение
к Договору на прохождение преддипломной практики студентами
Московского государственного университета имени М.В.Ломоносова
в Публичном акционерном обществе «Сбербанк»

Индивидуальное задание студента-практиканта

Студент 6 курса Токаева Александра Александровна

Руководитель от МГУ имени М.В. Ломоносова Лебедев Алексей Викторович

Руководитель от предприятия Аношин Сергей Александрович

Тема Исследование применимости эволюционных стратегий на рынке

Задание:

- Изучить наиболее распространенные на российском рынке производные финансовые инструменты (Interest Rates Swap, Cap/Floor, FX Forwards, FX Options)
- Изучить модели ценообразования для этих финансовых инструментов
- Изучить особенности еврооблигаций и замещающих облигаций
- Изучить связи и различия между облигациями и кредитными дефолтными свопами
- Изучить рекомендуемую литературу по курсу “Эволюционные методы в финансовой математике”
- Изучить возможность применимости известных моделей с короткоживущими и долгоживущими активами к рыночным данным
- Исследовать поведение полученной в дипломной работе эволюционной стратегии на рыночных данных
- Реализовать программный пакет на языке Python для вычисления доходностей рассматриваемых стратегий на рыночных данных
- Оформить отчет по результатам проделанной работы

ПАО «Сбербанк»:



Аношин С.А.

МГУ имени М.В.Ломоносова:

/Лебедев А.В.

Приложение

к Договору на прохождение преддипломной практики студентами
Московского государственного университета имени М.В.Ломоносова
в Публичном акционерном обществе «Сбербанк»

Календарный план-график студента-практиканта

Студент 6 курса Токаева Александра Александровна

Руководитель от МГУ имени М.В. Ломоносова Лебедев Алексей Викторович

Руководитель от предприятия Аношин Сергей Александрович

Тема Исследование применимости эволюционных стратегий на рынке

№ п/п	Разделы (этапы) практики	Даты работы, на практике включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в днях по этапам)	Формы текущего контроля
1.	Планирование научно-исследовательской работы, ознакомление с тематикой исследовательских работ в данной области и выбор темы исследования; посещение специальных занятий, ознакомление с используемым оборудованием. Изучение специальной литературы	01.03.2023-19.03.2023	Договор на прохождение практики, рабочие материалы для руководителя практики.
2.	Участие в проведении научно-исследовательской работы. Сбор, обработка, анализ и систематизация научно-технической информации по теме, изучение специальной литературы. Посещение специальных курсов, прохождение аттестационных мероприятий. Подготовка материала для отчёта.	20.03.2023-16.04.2023	Рабочие материалы для руководителя практики.
3.	Составление аналитического отчета о научно-исследовательской работе и его обсуждение на кафедре, возможна презентация материалов выполненной работы на конференциях.	17.04.2023-17.05.2023	Три приложения к договору на прохождение практики студентами.

ПАО «Сбербанк»:



Аношин С.А

МГУ имени М.В.Ломоносова:

/Лебедев А.В.

Приложение
к Договору на прохождение преддипломной практики студентами
Московского государственного университета имени М.В.Ломоносова
в Публичном акционерном обществе «Сбербанк»

Отчёт о практике студента-практиканта

Студента 6 курса Токаева Александра Александровна

Руководитель от МГУ имени М.В. Ломоносова Лебедев Алексей Викторович

Руководитель от предприятия Аношин Сергей Александрович

Тема Исследование применимости эволюционных стратегий на рынке

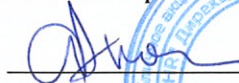
В ходе прохождения производственной практики были получены следующие результаты:

- Были изучены наиболее распространенные на российском рынке производные финансовые инструменты (Interest Rates Swap, Cap/Floor, FX Forwards, FX Options)
- Были изучены модели ценообразования для этих финансовых инструментов
- Были изучены особенности еврооблигаций и замещающих облигаций
- Были изучены связи и различия между облигациями и кредитными дефолтными свопами
- Была изучена рекомендуемая литература по курсу “Эволюционные методы в финансовой математике”
- Была изучена возможность применимости известных моделей с короткоживущими и долгоживущими активами к рыночным данным
- Было исследовано поведение полученной в дипломной работе эволюционной стратегии на рыночных данных
- Был реализован программный пакет на языке Python для вычисления доходностей рассматриваемых стратегий на рыночных данных
- Был оформлен отчет по результатам проделанной работы

В ходе преддипломной практики студент продемонстрировал навыки самостоятельной работы по решению поставленных ему задач и готовность использовать полученные им знания в дальнейшей работе.

Практическая работа заслуживает оценки: отлично.

ПАО «Сбербанк»:



/Аношин С.А.



МГУ имени М.В.Ломоносова:

/Лебедев А.В.