

Приложение

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

Индивидуальное задание студента-практиканта

Студента 6 курса Токаева Александра Александровна

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

Руководитель от предприятия Зиятдинов Искандер Шамилевич

Тема Верификация моделей ценообразования для опционов на валюту и процентные ставки

Задание:

- На примере корпоративного портфеля определить наиболее распространенные производные финансовые продукты и базовые активы
- Изучить модели ценообразования и расчета риск-метрик для этих финансовых инструментов
- Изучить модели расчета поправок на контрагентский риск (CVA)
- Реализовать программный пакет на языке Python для вычисления этих метрик на примере продуктов типа валютный форвард
- Провести сверку расчета поправок на контрагентский риск (CVA): независимый расчет против системы банка
- Оформить отчет по результатам проделанной работы

ПАО «Сбербанк»:

_____/Зиятдинов И.Ш

МГУ имени М.В.Ломоносова:

_____/Лебедев А.В.

