

### Отчёт о практике 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

В ходе прохождения производственной практики были получены следующие результаты:

- Был изучен корпоративный портфель производных инструментов, на его примере были определены наиболее распространенные производные финансовые продукты и базовые активы
- Были изучены модели ценообразования и расчета риск-метрик для этих финансовых инструментов
- Были изучены модели расчета поправок на контрагентский риск (CVA)
- Была изучена система контроля версий git
- Были реализована и верифицирована программа на языке Python для вычисления этих метрик на примере продуктов типа валютный форвард
- Было проведено сравнение расчета поправок на контрагентский риск (CVA): независимый расчет против системы банка
- Был оформлен отчет по результатам проделанной работы

В ходе производственной 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»:

МГУ имени М.В.Ломоносова:

\_\_\_\_\_/Зиятдинов И.Ш

\_\_\_\_\_/Лебедев А.В.

