

Univerzitet u Beogradu
Fizički fakultet, Studentski trg br 12.

SEMINAR KATEDRE ZA KOMPJUTERSKU FIZIKU

Poziv na predavanje koje će se održati u sredu 12. aprila 2023.
u 11.00 časova, u plavoj sali Fizičkog fakulteta:

STATISTIČKE OSOBINE KNJIGE LIMIT NALOGA

Koje će održati

Dragana Radojičić

Ekonomski fakultet, Univerzitet u Beogradu

dragana.radojicic@ekof.bg.ac.rs

Apstrakt:

Cilj ovog istraživanja je proučavanje dinamičkog ponašanja i statističkih svojstava knjige limit naloga. Izučava se model knjige stohastičkih limita u diskretnom vremenu i prostoru, vođen procesom jednostavnog simetričnog slučajnog hoda. Specijalna pažnja je na proučavanju varijable lavina, gde je lavina serija izvršenja naloga takvih da dužina perioda bez trgovinskog događaja ne može biti veća od $e > 0$. Dimanika modela nalaže da su moguća dva trgovinska mehanizma, naime trgovine tipa I i trgovine tipa II . Trgovina tipa I se dešava nakon izleta do sledećeg tekućeg maksimuma srednje cene proces, dok se trgovina tipa II dešava ako cena padne za m ili više, a zatim raste po m opet. Naš fokus je uglavnom na distribuciji dužine lavina naloga.

Biografija:

Dr Dragana Radojičić se bavi naučnim radom u oblasti stohastičke analize, statistike, finansijske matematike i mašinskog učenja. Tokom prethodnih pet godina održala je niz predavanja i učestvovala je na međunarodnim konferencijama u Francuskoj, Austriji, Ukrajini, Slovačkoj, Mađarskoj, Nemačkoj, Španiji, Ujedinjenom Kraljevstvu i Srbiji. Posebno, bila je izabrana među 10 mladih istraživača koji su imali priliku da predstave svoja istraživanja na 7. Hajdelberg Forumu Laureata. Stipendirana od Univerziteta u Oksfordu 2019. godine bila je na istraživačkoj poseti grupi Oxford Mathematical Computational Finance Group, gde je posebno sarađivala sa profesorom Ramom Kont, i gde je i napisala deo doktorske disertacije. Angažovana je kao docent na sledećim predmetima na osnovnim studijama: Matematička statistika, Teorija uzoraka i planiranje eksperimenata i Quantitative finance (Economics and Finance, u saradnji sa LSE); kao i na master studijama na predmetu Data mining and machine learning (IMQF).

Rukovodioci seminara:

Edib Dobradžić, vanredni profesor,

Ivan Belča, redovni profesor.

Sekretar seminara:

Zoran Nikolić, redovni profesor.