

Algoritmické obchodování

Přednášející: Mgr. Karel Janeček, Ph.D.

Místo a čas: úterý 6. prosince 2011, 18 -20:00 hodin, Ballingův sál NTK v Praze.

Obsah přednášky:

RSJ je jedním z největších obchodníků a poskytovatelů likvidity na světových finančních trzích (NYSE Liffe, CME Group, Eurex). Algoritmické obchodování je postavené na hluboké matematické analýze finančních trhů. V RSJ vyvíjíme a pravidelně aktualizujeme matematické modely, které jsou převáděny do softwarové podoby a provozovány na zmíněných světových burzách. Systémy RSJ obchodují plně automatizovaně a uzavírají v průměru 2,5 obchodu za sekundu, s ročním obratem v řádech biliard korun. Úspěchy, kterých společnost dosáhla, stojí na vysoké odbornosti a špičkových vědeckých znalostech zaměstnanců. V druhé části přednášky pohovoří Karel Janeček o společenských problémech, které ho vedly k založení NFKJ a NFPK.

Vstupní předpoklady:

Přednáška nevyžaduje žádné specifické znalosti. Výhodou je ale zájem o obor finanční matematika a matematické obchodování.

Anotace autora:

Mgr. Karel Janeček, Ph.D. získal v roce 2004 doktorát v oboru finanční matematika na Carnegie Mellon University. Po ukončení doktorandského studia pracoval jako vědecký pracovník v Johann-Radonově ústavu pro výpočetní a aplikovanou matematiku (RICAM), který spadá pod Rakouskou akademii věd. V současné době pracuje jako generální ředitel společnosti *RSJ algoritmické obchodování*, jejímž je zakladatelem a rovněž lektoruje kurzy finanční matematiky na Matematicko-fyzikální fakultě Univerzity Karlovy v Praze. Ve své firmě rozvíjí matematické algoritmy obchodování a je zodpovědný za strategii a další vizi rozvoje společnosti. Karel Janeček mimo jiné proslul i autorstvím blackjack softwaru pro profesionální hráče karetní hry Blackjack. Je rovněž zakladatelem nadačního fondu NFKJ, jehož cílem je podporovat především projekty základního výzkumu v oblasti ekonomie, matematiky, a medicíny a sponzorovat mladé vědce z České republiky.

Vstup: volný