

# RSJ Securities: Tvorba trhu na elektronické burze

Mgr. Anton Tyutin

RSJ Securities, součást finanční skupiny RSJ, je obchodník s cennými papíry působící na burzách v Londýně, Chicagu a Frankfurtu n. M. Obchoduje s finančními deriváty, zejména futures kontrakty. Hlavní strategií je market making (tvorba trhu), kdy obchodník současně nabízí, že aktivum koupí i prodá. Pro ostatní účastníky trhu se tak zvyšuje možnost zobchodování.

A jakou roli hrají v tomto byznysu matematici? Jaké úlohy řeší? Na přednášce se dozvíte, jak to vypadá v praxi konkrétního market makera. Na začátku si připomeneme základy burzovního mechanismu a nastíníme technologické postupy. Poté se podíváme na některé úkoly, které matematictí analytici řeší. Jsou z různých oblastí: matematické statistiky, finanční matematiky, numerické matematiky a matematické optimalizace. Hlavní pozornost bude věnována problematice statistických odhadů. Povídání o úlohách doprovodí nematematické poznámky a příběhy o jejich vzniku a řešení.

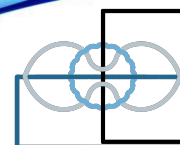


*Anton Tyutin vystudoval matematiku na ruské Uralské státní univerzitě v Jekatěrinburgu a teoretickou ekonomii na CERGE-EI v Praze. Od r. 2006 pracuje v Analytickém oddělení RSJ Securities. Věnuje se matematickému modelování obchodních strategií a řízení rizik. Je také členem představenstva RSJ Securities, a.s.*

**středa 13. března**

**17:30 v posluchárně T-201**

FJFI ČVUT, Trojanova 13



**MATEMATICKÉ  
PROBLÉMY  
NEMATEMATIKŮ**