

Działalność Koła Naukowego Finansów Obliczeniowych

Zarząd KNFO

Uniwersytet Warszawski

knfo@mimuw.edu.pl, knfo.mimwu.edu.pl

15. października 2018

Plan prezentacji

- 1 Informacje ogólne
- 2 Dotychczasowa działalność
- 3 Planowana działalność
- 4 Rejestracja

Informacje ogólne

- działamy od października 2017,
- opiekun: dr Maciej Wiśniewolski,
- zarząd w roku 2018/19 stanowią:
 - Michał Jaworski – m.jaworski@mimuw.edu.pl, pok. 4460
 - Jan Kościółkowski – jan.koscialkowski@student.uw.edu.pl,
 - Bartłomiej Polaczyk – b.polaczyk@mimuw.edu.pl, pok. 4500
 - Przemysław Ryś – przemyslaw.rys@students.mimuw.edu.pl,
- opis dotychczasowych spotkań znajduje się w pliku
 - <https://bit.ly/2EbRivP>
- wstępne założenie działalności na rok 2018/19 są przedstawione w pliku
 - <https://bit.ly/2AaZ6tS>

Dotychczasowa działalność

- odbyło się 11 spotkań *regularnych*, na których poruszane były następujące tematy:
 - całka stochastyczna, wzór Itô, model Blacka–Scholesa, model dwumianowy, proces Poissona, Blockchain & Bitcoin, model Hestona, metody interpolacji krzywych stóp procentowych, LIBOR market model, High Frequency Trading, zmienności implikowana oraz płaszczyzna zmienności, proces Coxa, instrumenty katastroficzne.

Dotychczasowa działalność



TWO SIGMA
**TWO SIGMA
INFO SESSION**
Two Sigma is one of the world's
Public - Hosted by Kolo Naukowe Finansów Obliczeniowych
MIMUW and QuantFin Foundation



QFRG
&
LABYRINTH HF
SPOTKANIE NA MIMUW
29.05.2018 godzina 18:00 sala 4420
Public - Hosted by Kolo Naukowe Finansów Obliczeniowych
MIMUW and QuantFin Foundation



Computational Finance Student Research Group (MIMUW)
and QuantFin Foundation invite to the lecture:
Market Risk Management in Investment Banking
speaker: **Nicolae Mera, PHD**
Head of Quantitative Risk & Capital Strategies, Models & Methodologies, Credit Suisse
Public - Hosted by Kolo Naukowe Finansów Obliczeniowych
MIMUW and QuantFin Foundation



Goldman Sachs
Make things possible.
Public - Hosted by Kolo Naukowe Finansów Obliczeniowych
MIMUW

Planowana działalność

Zarząd w roku akademickim 2018/19 planuje działalność w następujących obszarach:

- *regularnym;*
- *biznesowym;*
- *naukowym.*

Planowana działalność - *regularna*

Propozycje działalności na najbliższe miesiące:

- warsztat z Pythona od podstaw - 3 spotkania – raz na tydzień, pierwszeństwo dla Członków Koła.
- referowanie tematów zaproponowanych przez Członków Koła oraz tych znajdujących się w pliku (sekcji *Proposed talks in academic year 2018/19*):
 - <https://bit.ly/2EbRivP>
- grupowe projekty programistyczne – np. testowanie różnych strategii tradingowych

Planowana działalność - *biznesowa*



Planowana działalność - *naukowa*

- grupa badawcza prowadzona przez dr Macieja Wiśniewolskiego
- teoria procesów stochastycznych oraz zastosowania w matematyce finansowej
- spotkania co dwa tygodnie

Rejestracja

Oczekujemy, że osoby, które chcą uczestniczyć w działalności Koła wypełnią krótki formularz aplikacyjny znajdujący się na stronie:

- <https://goo.gl/forms/HSP9StR8yB8R09m11>

Dziękujemy za uwagę!