

Obchodování na burze a tvorba trhu

Vít Kubelka (Qminers)



EVROPSKÁ UNIE
Evropské strukturální a investiční fondy
Operační program Výzkum, vývoj a vzdělávání



Jak funguje obchodování na burze? Proč je jak pro burzu, tak pro účastníky finančních trhů důležité, aby na trzích byla dostatečná nabídka a poptávka? Vysvětlíme si základní pojmy z burzovního světa a řekneme si, kdo jsou takzvaní tvůrci trhu, kteří nabízejí jak nákupní tak prodejní cenu. Přítomnost tvůrců trhu pomáhá, mimo jiné, snižovat rozkolísanost cen a jejich důležitost podtrhuje i fakt, že sama burza často tvůrcům platí, aby pomáhali tvořit stabilní trh.

Základem kvalitní tvorby trhu (tzv. "market making") je algoritmus, který automaticky obchoduje. Nastíníme si, jak takové algoritmy pro obchodování na burze mohou vznikat, na jaké praktické problémy se může při jejich implementaci narazit a na závěr si krátce popovídáme o tom, jaké matematické metody se mohou při tvorbě těchto algoritmů používat.

Vít Kubelka vystudoval obor Pravděpodobnost, statistika, ekonometrie a finanční matematika na MFF UK v Praze. Po magisterském stupni pokračoval i v doktorandském studiu, které v roce 2020 úspěšně zakončil. Nyní pracuje ve firmě Qminers, kde se zabývá datovou analýzou a algoritmickým obchodováním.

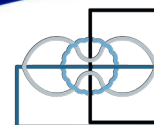


středa 5. října

17:30 v posluchárně K1

MFF UK, Sokolovská 49/83

nebo live stream na YouTube



**MATEMATICKÉ
PROBLÉMY
NEMATEMATIKŮ**