

Banskobystrický matematický seminár Aká si mi krásna ...

miesto konania: Katedra matematiky, prednášková miestnosť profesora Štefana Známa, č. 234

termín konania: nepárne utorky počas trvania semestra, v čase 13:00 - 14:00

Program na letný semester 2016/2017

Termín prednášky: 14. február 2017

Prednášajúci: prof. **Andrej Pázman**

Názov prednášky: Pojem informácie v matematickej štatistike

Termín prednášky: 28. február 2017

Prednášajúci: **Giselle Antunes Monteiro**

Názov prednášky: Dobrakov and Kurzweil integrals: related or not?

Abstrakt: Dobrakov integral is a Lebesgue type integral, being constructively defined. The Kurzweil integral, on the other hand, is a Riemann type integral. In this talk we discuss the attempts made in order to establish a connection between these two integration theories.

Termín prednášky: 7. marec 2017

Prednášajúci: prof. **Pavel Brunovský**

Názov prednášky: Krás(k)a za obzorom: teória spoločenskej voľby

Termín prednášky: 4. apríl 2017

Prednášajúci: prof. **Jacek Chudziak**

Názov prednášky: Quasideviation means and their applications

Termín prednášky: 11. apríl 2017

Prednášajúci: **Katarína Lučivjanská**

Názov prednášky: Optimal Granularity for Portfolio Choice

Abstrakt: Many optimization-based portfolio rules fail to beat the simple $1/N$ rule out-of-sample because of parameter uncertainty. In this paper we suggest a grouping strategy in which we first form groups of equally weighted stocks and then optimize over the resulting groups only. In a simplified setting we show analytically how to optimize the trade-off between drawbacks from parameter uncertainty and drawbacks from deviating from the overall optimal asset allocation. We illustrate that the optimal group size depends on the volatility of the assets, on the number of observations and on how much the optimal asset allocation differs from $1/N$. Out of sample back-tests confirm the validity of our grouping strategy empirically.