

ИЗВЕШТАЈ О ОЦЕНИ МАСТЕР РАДА

I ПОДАЦИ О КОМИСИЈИ
1. Датум и орган који је именовео Комисију 14.01.2011., Веће Департмана за математику и информатику Природно-математичког факултета Универзитета у Новом Саду
2. Састав Комисије са назнаком имена и презимена сваког члана, звања, назива уже научне области за коју је изабран у звање, датума избора у звање и назив факултета, установе у којој је члан комисије запослен: Др Данијела Рајтер-Ћирић, ванредни професор Природно-математичког факултета у Новом Саду - председник Др Зорана Лужанин, редовни професор Природно-математичког факултета у Новом Саду-ментор Др Бранко Урошевић, ванредни професор Економског факултета у Београду- члан Др Милош Божовић, доцент Природно-математичког факултета у Новом Саду-члан
II ПОДАЦИ О КАНДИДАТУ
1. Име, име једног родитеља, презиме: Соња (Жељко) Раушки
2. Датум рођења, општина, република: 28.10.1986. , Зрењанин, Србија
3. Година уписа на дипломске академске студије, смер/усмерење: 2009. , Мастер примењене математике/ финансијска математика
III НАСЛОВ МАСТЕР РАДА
Оптимизација портфолија када је време изласка неизвесно
IV ПРЕГЛЕД МАСТЕР РАДА
Рад је написан на 43 стране. Састоји се од 8 поглавља. Има 14 цитата и 12 слика. Поглавља: 1. Увод 2. Ознаке и дефиниције које ћемо користити у раду 3. Стандардни Марковицов модел 4. Генерализовани Марковицов модел 5. Инвестирање у страну тржиште 6. Секвенцијално квадратно програмирање 7. Нумеричко решавање 8. Закључак

V ВРЕДНОВАЊЕ ПОЈЕДИНИХ ДЕЛОВА МАСТЕР РАДА

У уводу рада је објашњен појам оптимизације портфолија. Затим су дате ознаке и дефиниције које су потребне у раду. У трећој глави тезе је формулисан проблем оптимизације портфолија, дат дијаграм портфолија као и скуп ефикасних портфолија. Затим је презентован један од модела оптимизације портфолија, стандардни Марковицов модел. У четвртој глави је посматран генерализовани Марковицов модел када је време изласка неизвесно. Разматрана су два случаја када када време изласка не зависи од приноса портфолија као и случај када зависи. У случају када време изласка зависи од приноса показано је да функција циља није конвексна, па се не могу применити глобалне методе решавања. Пета глава је генерализација резултата из друге главе на случај инвестирања у страну тржиште. Дата је нумеричка метода за решавање описаних проблема оптимизације портфолија, секвенцијално квадратно програмирање, у шестој глави. У седмом поглављу је тестирано секвенцијално квадратно програмирање на примеру. У последњем поглављу су резимирани резултати рада.

VI ЗАКЉУЧЦИ ОДНОСНО РЕЗУЛТАТИ ИСТРАЖИВАЊА

У овом раду је разматрана минимизација очекивања- варијансе када је време изласка неизвесно и презентована је компликација теоретских резултата. Изведен је модел за портфолио у страниј валути и одговарајући нумерички метод за решавање ових проблема узимајући у обзир да ови проблеми нису конвексни, па није могуће користити глобалне методе за решавање. Одговарајући нумерички метод је тестиран на примерима.

VII КОНАЧНА ОЦЕНА МАСТЕР РАДА

Мастер рад је у потпуности урађен у складу са одобреном темом. Сви проблеми наведени у пријави теме су детаљно анализирани и приказани. Рад је прегледно и добро написан, главни резултати су формулисани у облику теорема и примена на реалне проблеме. Докази су прегледно и математички коректно изведени. Рад садржи све елементе научног рада.

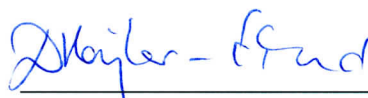
VIII ПРЕДЛОГ

На основу укупне оцене комисија предлаже да се мастер рад прихвати, а кандидату **Соњи Раушки** одобри одбрана.

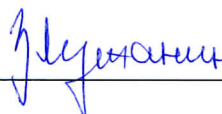
Нови Сад, 18.02.2011.

ПОТПИСИ ЧЛАНОВА КОМИСИЈЕ

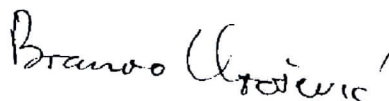
Др Данијела Рајтер- Тирић
Ванредни проф. ПМФ, председник



Др Зорана Лужанин
Редовни проф. ПМФ, ментор



Др Бранко Урошевић
Ванредни проф. Економског фак. у Београду, члан



Др Милош Божовић
Доцент ПМФ, члан

