



УНИВЕРЗИТЕТ УНИОН

РАЧУНАРСКИ ФАКУЛТЕТ

Broj 118/1

25.11.2010. god.

БЕОГРАД, Кнеза Михаила 6/в,



РАЧУНАРСКИ ФАКУЛТЕТ

**ИЗВЕШТАЈ О ПРИЈАВЉЕНИМ КАНДИДАТИМА
НА КОНКУРС ЗА ИЗБОР У ЗВАЊЕ НАСТАВНИКА УНИВЕРЗИТЕТА**

I ПОДАЦИ О КОНКУРСУ, КОМИСИЈИ И КАНДИДАТИМА

Орган који је расписао конкурс: Наставно-научно веће Рачунарског факултета

Датум доношења одлуке о расписивању конкурса: 24. 9. 2020.

УНИВЕРЗИТЕТ УНИОН - БЕОГРАД
КОДАГИНИЈЕ ВЕНАЦ 2/5

Место објављивања конкурса: дневни лист Политика

ПРИЈАВЉЕНО:	27.11.2020.		
Одл. дат:	Среда	Пријем	Издавац
	A 334-		
	-31/20		

Датум објављивања конкурса 21.10.2020.

Број наставника који се бира: 2 Звање у које се бира: Доцент

Ужа научна област: Економске науке

Састав комисије:

1. Урошевић Бранко	редовни професор	Економске науке
презиме и име	звање	ужа научна област
Универзитет у Београду, Економски факултет		Председник
установа у којој је запослен-а		функција у комисији
2. Вукелић Гордана	редовни професор	Економија и финансије
презиме и име	звање	ужа научна област
Универзитет Унион, Београдска банкарска академија – факултет за банкарство, осигурање и финансије		Члан
установа у којој је запослен-а		функција у комисији
3. Живковић Бошко	редовни професор	Економске науке
презиме и име	звање	ужа научна област
Универзитет у Београду, Економски факултет		Члан
установа у којој је запослен-а		функција у комисији

Пријављени кандидати:

1. презиме и име: Васиљевић Никола

2. презиме и име: Инђић Драго (у засебном извештају Комисије)

II БИОГРАФСКИ ПОДАЦИ О КАНДИДАТУ

1.1. Име, средње слово, презиме: Никола В. Васиљевић

Датум рођења: 14. новембар 1983.

Место и држава рођења: Београд, Србија

2.1. Професионална оријентација:

Наставно-научна област: Економске науке

Ужа научна област: Економске науке

2.2. Радно искуство:

	Организација	Трајање запослења	Звање
1.	Гимназија „Милош Савковић“, Аранђеловац, Србија	6 месеци	Наставник физике
2.	UniCredit Bank Serbia, Београд, Србија	5 месеци	Аналитичар – тржишни ризици и контролинг
3.	Department of Banking and Finance, University of Zurich, Цирих, Швајцарска	4 године 5 месеци	Истраживач и сарадник у настави
4.	Credit Suisse, Цирих, Швајцарска	7 година	Квантитативни аналитичар за инвестиционе стратегије
5.	Department of Banking and Finance, University of Zurich, Цирих, Швајцарска	1 година 8 месеци	Екстерни доцент
6.	Barclays Private Bank, Цирих, Швајцарска	5 месеци	Директор тима за квантитативне стратегије

2.3 Специјализације и студијски боравци у иностранству (у трајању дужем од две недеље):

1. <u>Универзитет у Цириху (University of Zurich)</u> Установа	Цирих, Швајцарска место и држава
Израда докторске дисертације из економије (финансије и банкарство) врста (циљ) боравка	12.09.2010 – 29.02.2016 период боравка
2. <u>Универзитет у Цириху (University of Zurich)</u> установа	Цирих, Швајцарска место и држава
Екстерни предавач на Мастеру из квантитативних финансија (заједнички програм Универзитета у Цириху и ETX) врста (циљ) боравка	01.02.2019 – период боравка

2.4. Докторске студије (за кандидате који су докторирали по закону који је важио до 2005. попунити само поља означенa сa *)

Година уписа: Година завршетка: Просечна оцена током студија:

Универзитет*: Универзитет у Цириху (University of Zurich)

Факултет*: Факултет за бизнис, економију и информатику (Faculty of Business, Economics and Informatics)

Студијски програм: Докторски програм из банкарства и финансија (Ph.D. in Banking and Finance)

Звање*: Доктор економских наука (Ph.D.) – оригинални назив: Doktor der Wirtschaftswissenschaften, Dr. oec.

Научна област*: Економске науке (акредитовано у Републици Србији)

Наслов дисертације*: Option Pricing and Market Risk Management in the Presence of Jump Risk

2.5. Мастер или магистарске студије

Година уписа: Година завршетка: Просечна оцена током студија:

Универзитет: Универзитет у Београду

Факултет: Економски факултет

Студијски програм: Мастер из квантитативних финансија (IMQF)

Звање: Мастер економиста (Master in Economics)

Научна област: Економија – квантитативне финансије

Наслов завршног рада: Jump Fears Make Volatility Smiles

2.6. Основне студије

Година уписа: Година завршетка: Просечна оцена током студија:

Универзитет: Универзитет у Београду

Факултет: Физички факултет

Студијски програм: Теоријска физика

Звање: Дипломирани физичар (еквивалент Мастеру)

2.7. Знање светских језика (унети ДА или НЕ као оцену)

Језик (навести језик)	Чита	Пише	Говори
енглески	ДА	ДА	ДА
немачки	ДА	ДА	ДА
француски	ДА	ДА	НЕ

2.8. Претходна звања (избор и реизбор)

Звање	Установа	Датум избора	Датум реизбора

III/н НАУЧНО-ИСТРАЖИВАЧКИ РАД (од избора у претходно звање)

3.1. Научни радови по категоријама

КАТЕГОРИЈЕ М11-М14: Монографије, монографске студије међународног значаја

Р. бр.	автори, наслов, издавач, број страница	Категорија
	UROŠEVIĆ, Branko, VASILJEVIĆ, Nikola, Dynamic Asset Liability Management in Insurance, In: <i>Insurance Market After COVID-19</i> , ISBN 978-86-403-1644-6, Kočović, J., Rakonjac-Antić, T., Jovanović Gavrilović, B., Boričić, B. (eds.), Belgrade: University of Belgrade – Faculty of Economics, 2020, Chapter 12, pp. 227-242	M14
	NEDELJKOVIĆ, Milan, VASILJEVIĆ, Nikola, Emerging Foreign Exchange Markets and Monetary Policy in Euro Area: Evidence From the Crisis, In: <i>EMAN 2020 Selected Papers – the 4th Conference on Economics and Management</i> , Publisher: UdEkoM Balkan et al., ISSN 2683-4510, pp. 11-25	M14

КАТЕГОРИЈЕ М15-М18: Лексикографске и картографске публикације међународног значаја

Р. бр.	автори, наслов, издавач, број страница	Категорија

КАТЕГОРИЈА М21: Рад у врхунском међународном часопису

Р. бр.	автори, наслов, часопис, број, странице	Категорија
1.	LEIPPOLD, Markus, VASILJEVIĆ, Nikola, Pricing and Disentanglement of American Puts in the Hyper-Exponential Jump-Diffusion Model, In: <i>Journal of Banking & Finance</i> , ISSN 0378-4266, 2017, Vol. 77, pp. 78-94, https://doi.org/10.1016/j.jbankfin.2017.01.014	M21a
2.	CHESNEY, Marc, VASILJEVIĆ, Nikola, Parisian Options with Jumps: A Maturity-Excursion Randomization Approach, In: <i>Quantitative Finance</i> , ISSN 1469-7688 (Print), ISSN 1469-7696 (Online), 2018, Vol. 72, April 2018, pp. 1887-1908, https://doi.org/10.1080/14697688.2018.1444785	M21
3.	LEIPPOLD, Markus, VASILJEVIĆ, Nikola, Option-Implied Intrahorizon Value at Risk, In: <i>Management Science</i> , ISSN 0025-1909 (Print), ISSN 1526-5501 (Online), 2020, Vol. 66, No. 1, pp. 397-414, https://doi.org/10.1287/mnsc.2018.3157	M21a

КАТЕГОРИЈА М22: Рад у истакнутом међународном часопису

Р. бр.	автори, наслов, часопис, број, странице	Категорија
		M22
		M22
		M22

КАТЕГОРИЈА М23: Рад у међународном часопису

Р. бр.	автори, наслов, часопис, број, странице	Категорија
		M23
		M23
		M23

КАТЕГОРИЈА М24: Рад у националном часопису међународног значаја

Р. бр.	аутори, наслов, часопис, број, странице	Категорија
		M24
		M24
		M24

КАТЕГОРИЈЕ М25-М28(а,б) Научна критика и полемика у истакнутом међународном часопису; Научна критика и полемика у међународном часопису; Научна критика и полемика у часопису ранга M24; На годишњем нивоу: а) главни одговорни уредник истакнутог међународног часописа или публикације са монографским делима категорије M13; б) уређивање истакнутог међународног научног часописа (гост уредник) или публикације са монографским делима категорије M14

Р. бр.	аутори, наслов, часопис, број, странице	Категорија

КАТЕГОРИЈЕ М31-М36 Зборници међународних научних скупова

Р. бр.	аутори, наслов, часопис, број, странице	Категорија
1.	UROŠEVIĆ, Branko, VASILJEVIĆ, Nikola, Portfolio Optimization – A Review, In: Proceedings of the 1 st Conference on Nonlinearity, ISBN 978-86-905633-4-0, Belgrade: Serbian Academy of Nonlinear Sciences, 2020, str. 66-91	M33

КАТЕГОРИЈЕ М41-49 Истакнута монографија националног значаја; Монографија националног значаја; Монографска библиографска публикација или монографска студија; Поглавље у књизи M41 или рад у истакнутом тематском зборнику водећег националног значаја; Поглавље у књизи M42 или рад у тематском зборнику националног значаја, лексикографске и картографске публикације националног значаја; уређивање тематског зборника, лексикографске или картографске публикације националног значаја)

Р. Бр.	аутори, наслов, часопис, број, странице	Категорија

КАТЕГОРИЈА М51: Рад у врхунском часопису националног значаја

Р. бр.	аутори, наслов, часопис, број, странице	Категорија

КАТЕГОРИЈА М52: Рад у истакнутом националном часопису

Р. бр.	аутори, наслов, часопис, број, странице	Категорија

КАТЕГОРИЈА М53: Рад у националном часопису

Р. бр.	аутори, наслов, часопис, број, странице	Категорија

КАТЕГОРИЈЕ М54-М56: Домаћи новопокренути научни часопис (на годишњем нивоу); Уређивање научног часописа националног значаја (на годишњем нивоу); Научна критика у часопису ранга М51; Научна критика у часопису ранга М52

Р. бр	пун наслов	Категорија

КАТЕГОРИЈА М61-М69: Предавања по позиву на скуповима националног значаја

Р. бр	аутори, наслов, зборник, број, странице	Категорија

КАТЕГОРИЈА М70: Одбрањена докторска дисертација

Р. бр	пун наслов, година	Категорија
1.	Option Pricing and Market Risk Management in the Presence of Jump Risk, 2016	M70

КАТЕГОРИЈА М81-М86: Техничка решења

Р. бр	пун наслов, година	Категорија

КАТЕГОРИЈА М91-94: Патенти; **М99** Ауторска изложба са каталогом уз научну рецензију

Р. бр	пун наслов, година	Категорија

3.1а Индекс компетенције

Категорија	M11	M12	M13	M14	M15	M16	M17	M18	M21a	M21	M22	M23	M24
Број публи.				2					2	1			
Број бодова				5					10	8			

Категорија	M25	M26	M27	M28a	M28б	M29a	M29б	M31	M32
Број публи.									
Број бодова									

Категорија	M33	M34	M35	M36	M41	M42	M43	M44	M45	M46
Број публи.	1									
Број бодова	1									

Категорија	M47	M48	M49	M51	M52	M53	M54	M55	M56	M57	M61	M62	M63	M64
Број публи.														
Број бодова														

Категорија	M65	M66	M67	M68	M69	M70	M81	M82	M83	M84	M85	M86	M87	M91
Број публи.						1								
Број бодова						6								

Категорија	M92	M93	M94	M99	M121	M122	M123	M124
Број публи.								
Број бодова								

ИСПУЊЕНОСТ МИНИМАЛНИХ УСЛОВА

Звање	Број бодова	Основни бодови ¹	Број радова са СЦИ листе ²	Испуњеност критеријума (ДА или НЕ)
Доцент	45	38	3	ДА
Ванредни професор				
Редовни професор				

¹основни бодови = 2x5 + 2x10 + 1x8 = 38

²радови са SCI листе: M21a (2 рад.); M21 (1 рад.).

Уколико је коришћена замена – навести:

3.2. Остало

3.2.1. Оригинално стручно остварење или руковођење или учешће у пројекту (обавезни услов за избор у звање ванредног професора)

Од 2019. године, екстерни предавач на Мастеру из квантитативних финансија (заједнички програм Универзитета у Цириху и ETH). Предаје напредни курс „Примењене квантитативне финансије“ који обрађује теме у вези са применама машинског учења у финансијама. Ментор завршних радова на поменутом Мастер програму. Активна сарадња са професорима и истраживачима на универзитетима у Швајцарској током протеклих десет година.

Осам година радног искуства у швајцарском банкарском сектору у области квантитативних стратегија у приватном банкарству. Након седам година рада у Credit Suisse (International Wealth Management), тренутно је директор тиме за квантитативне стратегије у Barclays Private Bank, где је одговоран за све квантитативне моделе (тактичке и стратешке инвестиције, конструкција портфеља, предвиђање кретања на финансијским тржиштима, процена ризика и хеџинг) који се примењују у оквиру ове дивизије банке. Блиска сарадња са приватним банкарима, инвестиционим аналитичарима, и менаџментом дивизије на глобалном нивоу.

3.2.2. Одобрен универзитетски уџбеник за предмет из студијског програма факултета, односно универзитета или научна монографија (са ISBN) бројем из научне области за коју се бира, у периоду од избора у претходно звање (обавезни услов за избор у звање ванредног и редовног професора)

3.2.3. Једно пленарно предавање на међународном или домаћем научном скупу или два саопштења на међународном или домаћем научном скупу (обавезни услов за избор у звање редовног професора).

1. XVIII Međunarodni simpozijum iz osiguranja Udruženja aktuara Srbije i Ekonomskog fakulteta Univerziteta u Beogradu sa temom „Budućnost tržišta osiguranja – optimistički ili pesimistički scenario?“, Aranđelovac, Srbija, od 4. do 7. juna 2020. Saopštenje objavljeno u zborniku:
UROŠEVIĆ, Branko, VASILJEVIĆ, Nikola, Dynamic Asset Liability Management in Insurance, In: *Insurance Market After COVID-19*, ISBN 978-86-403-1644-6, Kočović, J., Rakonjac-Antić, T., Jovanović Gavrilović, B., Borićić, B. (eds.), Belgrade: University of Belgrade – Faculty of Economics, 2020, Chapter 12, pp. 227-242
2. IV Međunarodna naučna konferencija EMAN sa temom „Economics & Management: How to Cope with Disrupted Times“, Ljubljana, Slovenija (održana virtualno), 3. septembar 2020. Saopštenje objavljeno u zborniku:
NEDELJKOVIĆ, Milan, VASILJEVIĆ, Nikola, Emerging Foreign Exchange Markets and Monetary Policy in Euro Area: Evidence From the Crisis, In: *EMAN 2020 Selected Papers – the 4th Conference on Economics and Management*, Publisher: UdEkoM Balkan, ISSN 2683-4510, pp. 11-25

3.2.4. Цитираност (најмање 10 хетероцитата – обавезни услов за избор у звање редовног професора)

Број цитата (без аутоцита):

11

Извор:

Google Scholar

Навести десет радова у часописима у којима је кандидат цитиран:

	Аутори, наслов рада, часопис, број, странице	Категорија
1.	Zhou, Z., Ma, J., & Sun, H. W. (2018). Fast Laplace transform methods for free-boundary problems of fractional diffusion equations. <i>Journal of Scientific Computing</i> , 74(1), 49-69.	M22
2.	Ma, J., Zhou, Z., & Cui, Z. (2017). Hybrid Laplace transform and finite difference methods for pricing American options under complex models. <i>Computers & Mathematics with Applications</i> , 74(3), 369-384.	M22
3.	Chen, R., Li, Z., Zeng, L., Yu, L., Lin, Q., & Liu, J. (2017). Option pricing under the double exponential jump-diffusion model with stochastic volatility and interest rate. <i>Journal of Management Science and Engineering</i> , 2(4), 252-289.	M23
4.	Zhou, Z., & Wu, H. (2018). Laplace Transform Method for Pricing American CEV Strangles Option with Two Free Boundaries. <i>Discrete Dynamics in Nature and Society</i> , 2018.	M23
5.	Ma, J., Cui, Z., & Li, W. (2019). Laplace Bounds Approximation for American Options. <i>Working paper, available at SSRN</i> .	-
6.	Farkas, W., & Mathys, L. (2020). Geometric Step Options with Jumps: Parity Relations, PIDEs, and Semi-Analytical Pricing. <i>Working paper, available at SSRN</i> .	-
7.	Rossello, D., & Lo Cascio, S. (2019). A Refined Measure of Conditional Maximum Drawdown. <i>Working paper, available at SSRN</i> .	-
8.	Patra, S., & Bhattacharyya, M. (2020). How Risky Are the Options? A Comparison with the Underlying Stock Using MaxVaR as a Risk Measure. <i>Risks</i> , 8(3), 76.	M23
9.	Jiang, W., & Kou, S. (2017). Simulating Risk Measures with Estimated Relative Errors. <i>Working paper</i> .	-

Звање	Број цитата	Испуњеност критеријума (ДА или НЕ)
Доцент	11	ДА

3.2.5. Признања, награде и одликовања за научни рад:

1. Стипендиста Министарства за науку и спорт (1998-2002)
2. Награда Њ.К.В. Александра II Карађорђевића за постигнут успех током школовања (2002)
3. Стипендиста Фондације за развој научног и уметничког подмлатка (2002-2009)
4. Стипендиста града Аранђеловца (2004-2008)
5. Стипендиста Српске академије наука и уметности (2005-2010)
6. Награда Eurobank EFG за најуспешније студенте завршних година универзитета у Србији (2006)
7. Стипендиста Швајцарског института за финансије (2010-2011)
8. Награда Народне банке Србије за најбоље Мастер радове из области економије (2012)
9. Награда Економског факултета у Београду за најбољи истраживачки рад на Конференцији за младе економисте (2016)

3.2.6. Чланство у научним и стручним организацијама:

1. Члан Европске финансијске асоцијације (European Finance Association)
2. Члан Америчке финансијске асоцијације (American Finance Association)

IV РАД У НАСТАВИ

4.1а Извођење наставе (од претходног избора)

Назив предмета: Financial Engineering (Финансијски инжењеринг)

Студијски програм: Quantitative Finance (Квантитативне финансије); настава на енглеском

Установа: Факултет за бизнис, економију и информатику (Универзитет у Цириху)

Степен студија: Мастер студије

Фонд часова: 30 (предавања) + 30 (вежбе)

Назив предмета: Applied Quantitative Finance (Примењене квантитативне финансије)

Студијски програм: Quantitative Finance (Квантитативне финансије); настава на енглеском

Установа: Факултет за бизнис, економију и информатику (Универзитет у Цириху)

Степен студија: Мастер студије

Фонд часова: 5 (предавања) + 30 (пројекти)

4.1б Оцена приступног предавања (код првог избора у наставно звање)

Тема предавања: Метод рандомизације за вредновање опција париског типа

Приступном предавању присуствовали су проф. др Бранко Урошевић, Економски факултет Универзитета у Београду (председник комисије), проф. др Бошко Живковић, Економски факултет Универзитета у Београду и проф. др Милан Недељковић, ФЕФА, Универзитет Метрополитан.

- 1) *Припрема предавања.* Кандидат Никола В. Васиљевић је припремио приступно предавање на тему *Метод рандомизације за вредновање опција париског типа*. Добра припрема се огледала у томе да је предавање било добро организовано, а презентација врло квалитетна.
- 2) *Структура и квалитет садржаја предавања.* Предавање је структурирано тако да садржи уводно излагање где је кандидат образложио важност теме и основне резултате. Даље, кандидат је на јасан начин представио врло комплексни модел хипер-експоненцијалних стохастичких процеса са скоковима који лежи у основи рада који је излагао. После тога је изложио, укратко, проблем вредновања опција париског типа и објаснио математички модел који се користи за њихово вредновање. Даље је објашњен иновативни приступ рандомизације у циљу решавања проблема вредновања опција оваквог типа после чега су представљени емпиријски резултати где је кандидат тестирао своје теоријске предикције на подацима са тржишта опција. Најзад, представио је закључке где је подвикао основне доприносе свог рада и практичну корист од овог новог методолошког приступа. Добро постављена структура резултовала је у врло квалитетном садржају предавања.
- 3) *Дидактичко-методички аспект извођења предавања.* Кандидат је тематику предавања изложио у логичком редоследу, на занимљим и разумљив начин иако је тематика била технички изузетно сложена. Предавање је било мотивисано и пропраћено бројним подацима и примерима из финансијске праксе.

4.1в Мишљење студената о педагошком раду

Анкете

Наставни предмет	Школска година	Оцена Студената	Број студената
Financial Engineering (Финансијски инжењеринг)	2013/2014	4.76	48
Applied Quantitative Finance (Примењене квантитативне финансије)	2018/2019	4.67	9
Applied Quantitative Finance (Примењене квантитативне финансије)	2019/2020	5.0	9

Остало

4.2. Увођење нових области или наставних предмета

Др Никола Васиљевић је увео нови предмет („Примењене квантитативне финансије“) на мастер програму из квантитативних финансија на Универзитету у Цириху. Теме које се обрађују у оквиру овог курса су веома популарне и актуелне, а тичу се примена машинског учења у модерним финансијама. Ова област истраживања је тренутно у експанзији, али многи мастер програми у Европи нису још увек увели одговарајуће курсеве. Кључни елемент је фокус на применама: интензиван рад са подацима и програмирање. С обзиром да већ постоји пар предмета на Универзитету у Цириху и ETH који покривају теоријске аспекте машинског учења, на овом курсу је нагласак на практичном раду кроз пројекте. Према томе, приступ учењу је иновативан у смислу да студенти не решавају класичне проблеме из уџбеника, већ током три месеца раде у тимовима од двоје или троје на репликацији скорашињих утицајних истраживачких радова (објављених у водећим часописима или представљених јавности као радни папери током претходне три до четири године). Поред репликације истраживачких радова током које студенти уче нове методе и имају регуларне консултације са ментором (предавачем), нагласак се ставља и на критичко размишљање и покушај да се постојећи радови унапреде или да се изучавање технике и методе примене и на другачијим подацима. Као резултат овог интензивног процеса, неколико студената се заинтересовало за даља истраживања у овом правцу. Неки од њих су одлучили да напишу своје мастер тезе, а неки и да почну своје докторске студије из ове области. Премда је група полазника релативно мала јер су захтеви за учешће на курсу високи, током протекле две године студенти су били веома задовољни и истицали су архитектуру курса као единствену. Кроз практичан приступ студенти стичу бројне вештине и постављају темеље за даља истраживања у области која све више поприма обрисе кључног стуба портфолија знања будућих кандидата на финансијском тржишту рада, као и у економским академским круговима.

4.3а Уџбеници

4.3б Друга дидактичка средства

Скрипта и слајдови за предавања из „Финансијског инжењеринга“ на мастер програму из квантитативних финансија на Универзитету у Цириху, Швајцарска.

4.5. Остало

4.5.1. Признања, награде и одликовања за педагошки рад:

- 1.
- 2.

4.5.2. Извођење наставе на универзитетима ван земље:

1. Др Никола Васиљевић је, до сада, искључиво предавао у иностранству. Поред горенаведених предмета у својству наставника, био је такође асистент на предметима: Advanced Corporate Finance (Напредне корпоративне финансије) 2011/2012 и 2012/2013, Financial Engineering (Финансијски инжењеринг) 2014/2015 и 2015/2016. Ови предмети држани су на Универзитету у Цириху током његових докторских студија.

ИСПУЊЕНОСТ МИНИМАЛНИХ КРИТЕРИЈУМА (рад у настави)

<i>Звање</i>	<i>Оцена студената</i>	<i>Уџбеник</i>	<i>Остале дидактичка средства</i>	<i>Испуњеност критеријума (ДА или НЕ)</i>
Доцент	4.81	НЕ	ДА	ДА
Ванредни професор				
Редовни професор				

V РЕЗУЛТАТИ У РАЗВОЈУ НАУЧНОНАСТАВНОГ/УМЕТНИЧКО-НАСТАВНОГ ПОДМЛАТКА И УЧЕШЋЕ У КОМИСИЈАМА ЗА ОДБРАНУ ЗАВРШНИХ РАДОВА (обавезни услов за избор у звање редовног професора)

5.1 Учешће у комисији за одбрану радова

Основне студије

Укупан број менторстава: 9

У табели наведите највише 5 одбрањених завршних радова

	Презиме и име студента	Наслов рада, година одбране	Област	Својство (ментор/члан)
1.	Silvan Camenzind	The short-run performance of IPOs in Switzerland from 1997 to 2011 (2012)	Corporate Finance	Ментор
2.	Alexandra Egg	The influence of the shareholder constellation on the stock performance (2013)	Corporate Finance	Ментор
3.	Tian Xia	An empirical test of different factor models on the Shanghai stock exchange (2014)	Empirical Asset Pricing	Ментор
4.	En Coc Lien	Momentum strategies in the Swiss stock market (2015)	Empirical Asset Pricing	Ментор
5.	Daniel Podgorski	An inquiry into relative performance of risk measures for emerging stock markets (2016)	Risk Management	Ментор

Мастер студије или магистарске тезе

Укупан број менторстава: 15

У табели наведите највише 5 одбрањених завршних радова

	Презиме и име студента	Наслов рада, година одбране	Област	Својство (ментор/члан)
1.	Warrick Poklewski-Koziell	Inflation modeling: Risk premia and derivative pricing (2013)	Financial Engineering	Ментор
2.	Sarah Jucker	Pricing S&P 500 options under a stochastic volatility model (2014)	Financial Engineering	Ментор
3.	Alfiya Shamisheva	Systematic risk and portfolio allocations for private markets (2015)	Empirical Asset Pricing	Ментор
4.	Jan Tepina	Option-implied asset allocation (2016)	Financial Engineering	Ментор
5.	Patrick Lucescu	Testing stock returns predictability using option data: A machine learning approach (2020)	Financial Engineering & Empirical Asset Pricing	Ментор

Специјалистичке студије

Укупан број менеторстава:

У табели наведите највише 5 одбрањених завршних радова

	Презиме и име студента	Наслов рада	Област	Година одбране
1.				
2.				
3.				

Докторске дисертације/Докторски уметнички пројекти

Укупан број менторстава:

презиме и име студента: _____

наслов рада: _____

факултет (универзитет): _____

област: _____

датум одбране: _____

својство (ментор/члан): ментор _____

5.3. Испуњеност услова за менторство на докторским студијама (у складу са Стандардом 9 за акредитацију студијских програма докторских студија) – за избор у звање редовног професора, или и за избор у звање ванредног професора у пољу природно-математичких наука.

ИСПУЊЕНОСТ МИНИМАЛНИХ КРИТЕРИЈУМА

	Број менторстава по нивоима студија	Учешће у комисијама по нивоима студија	Услови за менторство на докторским студијама (ДА или НЕ)
1.	Основне:	9	
2.	Специјалистичке:		
3.	Магистарске		
4.	Мастер	15	
5.	Докторска дисертација/докторске студије:		

VI ДОПРИНОС АКАДЕМСКОЈ И ШИРОЈ ЗАЈЕДНИЦИ

6.1 Учешће у раду органа и тела факултета и Универзитета

Орган или тело	Факултет или Универзитет	Период
Докторски програм Департмана за банкарство и финансије: докторант-ментор (помоћ новим докторантима)	Универзитет у Цириху, Швајцарска	2014. и 2015. године

6.2 Учешће у комисијама за изборе у звања

Име и презиме кандидата	Својство (председник/члан)	Установа

6.3 Вођење професионалних (стручовних) организација или учешће у њиховом раду

Организација	Функција	Период
European Finance Association	Члан	Од 2014. до данас
American Finance Association	Члан	Од 2014. до данас

6.4 Учешће у организацији и вођењу скупова, конференција, манифестација

Скуп, конференција, манифестација	Функција	Година
<i>Fin & Math Doc Seminar UZH/ETH</i> Заједнички семинар Департмана за банкарство и финансије Универзитета у Цириху и групе за финансијску математику са ETH	Ко-организатор (са стране Универзитета у Цириху) са представником ETH	2014. и 2015. године
<i>SFI Corporate Finance Workshop 2014</i> Интернационална радионица за докторанте из области корпоративних финансија	Ко-организатор	2014. године

6.5 Учешће у раду одбора, законодавних тела и друго

Одбор, тело ...	Врста рада	Период

6.6 Рецензије у научном часописима и остале јавне рецензије

Часопис	Категорија
Рецензије у следећим престижним међународним часописима	
Journal of Banking and Finance	M21A
Quantitative Finance	M21
Quantitative Finance and Economics	M23
International Journal of Information Technology & Decision Making	M23

6.7. Подржавање ваннаставних академских активности студената

Ко-организација семинара из финансијске математике (*Fin & Math Doc Seminar UZH/ETH*) са колегама са ETH у Цириху. Током две године (2014. и 2015.), на месечном нивоу се одржавао семинар на коме су чланови истраживачких група које са баве квантитативним финансијама на Универзитету у Цириху и ETH презентовали сопствене и дискутовали радне папире других учесника семинара. Семинар је организован са идејом о бољем упознавању и приближавању две истраживачке групе које се баве сличним темама, с тим што једна наглашава економске и финансијске аспекте док се друга претежно фокусира на математичке методе.

Ко-организација међународне докторске радионице (под покровитељством Департмана за банкарство и финансије на Универзитету у Цириху и Швајцарског финансијског института) из корпоративних финансија (*SFI Corporate Finance Workshop 2014*) са још једним докторантом. Главни циљ радионице је био да се започне серија радионица за докторске студенте на којима би они имали прилику да презентују своја теоријска и емпиријска истраживања. Студенти са иностраних универзитета су такође учествовали, што је повећало компетитивност и диверзитет радионице. Такође, то је омогућило докторантима да прошире своју академску мрежу и повежу се са иностраним колегама колегама. Сви учесници су поред сопствених презентација допринели и дискусијом радова других учесника. Неколико уважених професора из Швајцарске је увеличало догађај својим пленарним предавањима. Напослетку, вреди поменути да је ова радионица започела серију сличних догађаја који се организују сада већ већ шест година.

Ментор-докторант 2014. и 2015. године на докторском програму из финансија на Департману за банкарство и финансије Универзитета у Цириху. Током свог мандата ментор-докторант има улогу главног контакта за студенте који похађају прву годину докторских студија. Главне обавезе су помоћ у вези са свим организационим и административним питањима, као и организација друштвених догађаја (окупљања) на којима нови студенти имају прилику да упознају старије докторанте и професоре.

6.8. Учешће у наставним активностима које не доносе ЕСПБ бодове

6.9. Допринос активностима које побољшавају статус углед и статус факултета и универзитета

Друго:

Организација радионица и семинара (погледати одељак 6.7).

Увођење новог и напредног Мастер курса „Примењене квантитативне финансије“ (погледати одељак 4.2).

Учешће на врхунским међународним конференцијама (погледати поглавље VIII).

ИСПУЊЕНОСТ МИНИМАЛНИХ КРИТЕРИЈУМА

Кандидат Никола Васиљевић, у погледу доприноса академској и широј заједници, испуњава све постављене критеријуме:

- Научни назив доктора економских наука на Универзитету у Цириху, Швајцарска (докторска диплома нострификована у Србији у складу са Законом о високом образовању). Критеријуми просечне оцене веће од осам (8), или најмање три године педагошког искуства на високошколској установи су такође испуњени (ефективно, просечна оцена десет и шест година педагошког искуства).
- Одржао је приступно предавање које је позитивно оцењено.
- Објављена три рада из категорије M20 (два рада M21A и један рад M21) из области економских наука.
- Учешће у раду органа и тела факултета и Универзитета (докторант-ментор на Департману за банкарство и финансије Универзитета у Цириху, Швајцарска).
- Учешће у раду професионалних (стручовних) организација (члан две професионалне организације).
- Учешће у организацији и вођењу скупова, конференција, манифестација (ко-организатор једног семинара и једне међународне докторске радионице на Универзитету у Цириху, Швајцарска).
- Рецензије у научном часописима (рецензент четири међународна научна часописа).
- Подржавање ваннаставних академских активности студената (организација семинара и радионица за младе истраживаче).
- Допринос активностима које побољшавају статус углед и статус факултета и универзитета (организација међународне радионице за младе истраживаче из области финасија и увођење новог курса на Мастер програму из квантитативних финансија на Универзитету у Цириху, Швајцарска).

VII СТРУЧНО-ПРОФЕСИОНАЛНИ ДОПРИНОС

7.1. Учешће и руковођење научним/уметничким и другим пројектима

назив пројекта: „Вредновање америчких опција“
финансиран (од кога): Swiss Finance Institute & Vontobel Bank
врста пројекта: пројекат основних истраживања
период: 2011-2014
својство (руководилац/учесник): Учесник

назив пројекта: “ Вредновање егзотичних опција”
финансиран (од кога): Swiss Finance Institute
врста пројекта: пројекат основних истраживања
период: 2013-2016
својство (руководилац/учесник): Учесник

назив пројекта: „Вредновање опција и менаџмент ризика“
финансиран (од кога): Swiss Finance Institute & Vontobel Bank
врста пројекта: пројекат основних истраживања
период: 2014-2016
својство (руководилац/учесник): Учесник

7.2. Обављање консултантских послова

7.3. Уређивачки послови

7.4. Консултантске и сличне активности

UniCredit Bank, Београд, Србија (март-јул 2010). Радио као квантитативни аналитичар на пројектима везаним за тржишне ризике, стратешке аквизиције банке, и на развоју Fund Transfer Pricing (FTP) методологије.

Credit Suisse, International Wealth Management, Цирих, Швајцарска (мај 2013-април 2020). Радио у тиму инвестиционих стратегија као квантитативни аналитичар. Главни пројекти: стратешка и тактичка улагања, портфолио оптимизације, процене кретања на финансијским тржиштима, процене ризика, екстракција информација из података доступних на тржиштима деривата. Члан саветодавне групе за методологије рачунања ризика. Допринос развоју роботизованих инвестиционих алатки.

Barclays Private Bank, Цирих, Швајцарска (мај 2020-данас). Директор тима за квантитативне стратегије. Одговоран за све квантитативне моделе (дугорочне и краткорочне) у инвестиционим стратегијама.

VIII САРАДЊА СА ДРУГИМ ВИСОКОШКОЛСКИМ, НАУЧНОИСТРАЖИВАЧКИМ, ОДНОСНО ИНСТИТУЦИЈАМА КУЛТУРЕ ИЛИ УМЕТНОСТИ

Презентације истраживачког рада на међународним конференцијама:

- “Optimal currency exposure under risk and ambiguity aversion”. American Finance Association Annual Meeting, San Diego, USA, 2020
- “Intra-horizon expected shortfall and risk structure in models with jumps”, Quantitative Methods in Finance 2019 Conference, Sydney, Australia, 2019
- “Intra-horizon expected shortfall and risk structure in models with jumps”, Vienna Congress on Mathematical Finance, Vienna, Austria, 2019
- “Intra-horizon expected shortfall and risk structure in models with jumps”, 9th General Advanced Mathematical Methods in Finance Conference, Paris, France, 2019
- “Optimal currency exposure under risk and ambiguity aversion”, 26th Forecasting Financial Markets Conference, Venice, Italy, 2019
- “Option-implied intrahorizon value at risk”, 9th Bachelier Finance Society World Congress, New York, USA, 2016
- “Option-implied intrahorizon value at risk”, Belgrade Young Economist Conference 2016, Belgrade, Serbia, 2016
- “Parisian options with jumps: A maturity–excursion randomization approach”, 8th Bachelier Finance Society World Congress, Brussels, Belgium, 2014
- “Analytic approximation to American put for jump-diffusion processes”, 7th Bachelier Finance Society World Congress, Sydney, Australia, 2012

Презентације истраживачког рада на радионицама и семинарима:

- “Optimal currency exposure under risk and ambiguity aversion”, Swiss Finance Institute Research Days, Gerzensee, Switzerland, 2019
- “Optimal currency exposure under risk and ambiguity aversion”, Seminar at the Department of Banking and Finance, University of Zurich, Zurich, Switzerland, 2019
- “Option-implied intrahorizon value at risk”, Seminar at the Department of Banking and Finance, University of Zurich, Zurich, Switzerland, 2015
- “Option-implied intrahorizon value at risk”, Swiss Finance Institute Research Days, Gerzensee, Switzerland, 2015
- “Parisian options with jumps: A maturity–excursion randomization approach”, Swiss Finance Institute Research Days, Gerzensee, Switzerland, 2014
- “Pricing and disentanglement of American puts in the hyper-exponential jump–diffusion model”, Fin & Math Doc Seminar, ETH, Zurich, Switzerland, 2013
- “Pricing and disentanglement of American puts in the hyper-exponential jump–diffusion model”, Seminar at the Department of Banking and Finance, University of Zurich, Zurich, Switzerland, 2013
- “Analytic approximation to American put for jump-diffusion processes”, 11th Swiss Doctoral Workshop in Finance, Gerzensee, Switzerland, 2011
- “Analytic approximation to American put for jump-diffusion processes”, Seminar at the Department of Banking and Finance, University of Zurich, Zurich, Switzerland, 2011

IX АНАЛИЗА РАДА КАНДИДАТА (на једној страници; истаћи испуњеност тражених услова)

Др Никола Васиљевић је завршио Мастер студије физике (смер теоријска физика) 2008. године и Мастер студије економије (смер квантитативне финансије) 2011. године на Универзитету у Београду. Докторирао је економске науке (смер банкарство и финансије) на Факултету за бизнис, економију и информатику на Универзитету у Цириху 2016. године. Од маја 2020. године је запослен као директор тима за квантитативне стратегије у Barclays Private Bank, Цирих, Швајцарска. Пре запослења у Barclays Private Bank, радио је седам година у Credit Suisse у дивизији International Wealth Management као квантитативни аналитичар у тиму за инвестиционе стратегије.

Од 2019. године ангажован је као екстерни доцент на Департману за банкарство и финансије на Универзитету у Цириху где је креирао и предаје курс „Напредне квантитативне финансије“ (примене метода машинског учења у финансијама) на Мастеру из квантитативних финансија. Др Никола Васиљевић има шест година педагошког искуства на Универзитету у Цириху. Током тог периода, био је наставник на три курса и асистент на додатна четири курса. Такође, био је ментор девет теза на основним и 15 теза на мастер студијама, као и на 24 семестарска пројекта.

Бави се истраживањима из области финансијског инжењеринга, портфолио оптимизација и примена напредних статистичких метода у финансијама. Објавио је три рада у престижним часописима *Management Science*, *Journal of Banking and Finance*, и *Quantitative Finance*. Такође, допринео је публикацијама у две монографије, као и једним ревијалним радом у зборнику конференцијских радова. Његова досадашња истраживања претежно се баве ризицима наглих скокова на финансијским тражиштима и њиховим утицајем на цене финансијских деривата. Нови правци истраживања укључују валутне ризике, оптималне инвестиције на дуги рок, као и примене машинског учења за предвиђање кретања цена различитих финансијских инструмената на светским берзама.

Његов истраживачки рад је до сада презентован на 18 међународних конференција, радионица и семинара у Швајцарској, Италији, Француској, Белгији, Аустрији, Србији, Сједињеним Америчким Државама и Аустралији, укључујући American Finance Association Annual Meeting, Bachelier Finance Society World Congress, Quantitative Methods in Finance Conference, и Vienna Congress of Mathematical Finance. Повремени је рецензент међународних часописа из области економије и финансија, као што су *Journal of Banking and Finance* и *Quantitative Finance*.

Х МИШЉЕЊЕ О ИСПУЊЕНОСТИ УСЛОВА ЗА ИЗБОР У ЗВАЊЕ СВАКОГ КАНДИДАТА ПОСЕБНО

На конкурс за ужу научну област Економске науке пријавља су се два кандидата: др Никола Васиљевић и др Драго Инђић. Мишљење о испуњености услова за избор у звање др Драга Инђића дато је у посебном извештају.

Имајући у виду да ужа научна област Економске науке припада научном пољу друштвено-хуманистичких наука, у наставку следи мишљење о испуњености услова за кандидата др Николу Васиљевића.

Општи услов:

Кандидат Никола Васиљевић је научни назив доктора економских наука стекао на Универзитету у Цириху 2016. године. Докторску диплому је нострификовала у Србији 2019. године у складу са Законом о високом образовању. Завршио је докторске студије са максималном просечном оценом. Укупно има шест година педагошког искуства на Универзитету у Цириху.

Обавезни услови:

1. Позитивно оцењено приступно предавање из области за коју се бира: **испуњен**
2. Искуство у педагошком раду са студентима: **испуњен** (кандидат има педагошког искуства на високошколској установи и конзистентно је позитивно оцењен у студентским анкетама).
3. Позитивна оцена педагошког рада у студентским анкетама током целокупног протеклог изборног периода (ако га је било): **испуњен** (просечна оцена на анкетама: 4.81).
4. Објављен један рад из категорије M20 или три рада из категорије M51 из научне области за коју се бира: **испуњен** (објављена укупно 3 рада – 2 рада из категорије M21A и један рад из категорије M21).

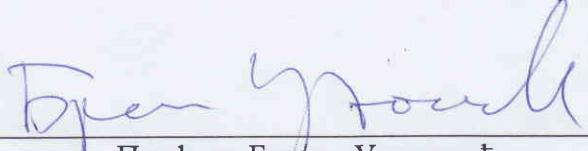
Изборни услови за сва звања (испуњеност најмање два од три понуђена елемента) **испуњени**

1. Стручно-професионални допринос: учесник на научном пројектима, рецензент у међународним часописима, радно искуство у водећим светским банкама.
2. Допринос академској и широј заједници: креирање новог и напредног мастер курса на Универзитету у Цириху, менторство мастер студената.
3. Сарадња са другим високошколским, односно научно-истраживачким институцијама у земљи или иностранству: организација и учешће на међународним конференцијама и радионицама.

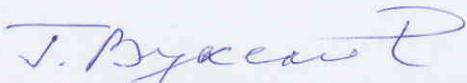
XI ПРЕДЛОГ ЗА ИЗБОР КАНДИДАТА У ОДРЕЂЕНО ЗВАЊЕ НАСТАВНИКА

Констатујући да су сви неопходни услови које прописује Правилник о избору у звања наставника Универзитета „Унион“ од 29.05.2018. године испуњени, Комисија предлаже Универзитету „Унион“ да стави овај извештај на увид јавности у трајању од 30 календарских дана, те да, уколико не буде било примедби, Наставно – научно веће Рачунарског факултета донесе одлуку којом Сенату Универзитета „Унион“ предлаже да се др **Никола Васиљевић** изабере у звање доцента за ужу научну област Економске науке.

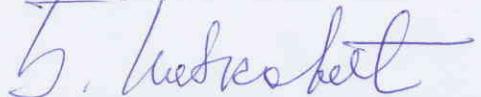
Датум: 23.11.2020. год.



Проф. др Бранко Урошевић
председник комисије



Проф. др Гордана Вукелић



Проф. др Бошко Живковић