

SZAKMAI ÖNÉLETRAJZ

Név:

Orlovits Zsanett

Születési hely, idő:

Tatabánya, 1979. május 14.

E-Mail:

orlovits@math.bme.hu

Iskolai tanulmányok:

- 1997-2003: alkalmazott matematikus szak, Eötvös Loránd Tudományegyetem, Természettudományi Kar
2003. június 24.: okleveles alkalmazott matematikus diploma, Eötvös Loránd Tudományegyetem, Természettudományi Kar
Diplomamunka címe: *Tőzsdei termékek hosszú emlékezetű modelljei*. Témavezető: Dr. Márkus László, matematikai tudomány kandidátusa.
- 2003-2006: doktorandusz hallgató, Matematika Doktori Iskola, Alkalmazott Matematika Program, Eötvös Loránd Tudományegyetem
Disszertáció címe: *Statistical analysis of stochastic volatility models*. Témavezető: Dr. Gerencsér László, MTA doktora.
2012. május 3.: doktori (PhD) fokozat, matematika és számítástudományok (alkalmazott matematika szakterület), summa cum laude minősítéssel.

Munkahelyek:

- 2003-2007: MTA SZTAKI, Sztochasztikus Rendszerek Kutatócsoport, tudományos segédmunkatárs
- 2006-2012: Budapesti Műszaki és Gazdaságtudományi Egyetem, Matematika Intézet, Differenciálegyenletek Tanszék, egyetemi tanársegéd
- 2012-: Budapesti Műszaki és Gazdaságtudományi Egyetem, Matematika Intézet, Differenciálegyenletek Tanszék, adjunktus

Kutatási terület:

Sztochasztikus volatilitás-folyamatok és alkalmazásai, sztochasztikus rendszerek és pénzügyi alkalmazásai, gazdasági idősorok modellezése és elemzése.

Nyelvismeret:

Angol középfokú C típusú nyelvvizsga
Német alacsonyfokú C típusú nyelvvizsga

Oktatási tevékenység:

- 2003-2006: Pázmány Péter Katolikus Egyetem, Budapest, Matematikai Analízis gyakorlatok vezetése mérnökhallgatóknak
- 2006- : Budapesti Műszaki és Gazdaságtudományi Egyetem, Matematika előadások és gyakorlatok vezetése BSc és MSc mérnökhallgatóknak, Ökonometria és haladó ökonometria előadás matematikus MSc és közgazdász elemző MSc hallgatóknak
- 2010-2011: Pázmány Péter Katolikus Egyetem, Esztergom (kihelyezett szak), Valószínűségszámítás és statisztika előadás mérnök-informatikus hallgatóknak

Elnyert ösztöndíjak és kutatási pályázatok:

- 2003-2006: MTA fiatal kutatói ösztöndíj, MTA
Témavezető: Dr. Gerencsér László, MTA SZTAKI, Sztochasztikus Rendszerek Kutatócsoport
- 2003-2007: Sztochasztikus Rendszerek és Pénzügyi Piacok Modellezése, OTKA T 047193, Vezető kutató: Dr. Gerencsér László

Alkalmazott projektek:

- 2010 : Morgan Stanley 2010 University Research and Development program, opcióárzási és árfolyam dinamikai modellezés Lévy folyamatokkal gerjesztett GARCH modellek segítségével
- 2011 szeptember: TESCO Global Áruházak Zrt. megbízásából egyetemi K+F projekt a TESCO akciós termékadás tervezési és modellezési problémáira

Tagság szakmai szervezetekben:

- 2005-2007: IEEE Control System Society tagság

Díjak:

2005: Doktoranduszi díj, MTA SZTAKI
2011: Kar Kiváló Oktatója, BME Természettudományi Kar
2012: Farkas Gyula Díj, Bolyai János Matematikai Társulat, Budapest

Egyéb szakmai tevékenységek:

European Control Conference (ECC), Conference on Decision and Control (CDC)
konferencia-cikkek bírálata.

Budapest, 2013. február 8.