

ЗАХТЕВ  
ЗА ДАВАЊЕ САГЛАСНОСТИ НА ИЗВЕШТАЈ О УРАЂЕНОЈ  
ДОКТОРСКОЈ ДИСЕРТАЦИЈИ

Шифра за идентификацију дисертације \_\_\_\_\_  
Шифра УДК (бројчано) 51

Веб адреса на којој се налази извештај Комисије о урађеној докторској дисертацији:  
[www.kg.ac.rs](http://www.kg.ac.rs)

СТРУЧНОМ ВЕЋУ ЗА ПРИРОДНО-МАТЕМАТИЧКЕ НАУКЕ УНИВЕРЗИТЕТА У  
КРАГУЈЕВЦУ

Молим да у складу са чл. 30 Закона о високом образовању и чл. 48 Статута Универзитета  
дате сагласност на извештај комисије о урађеној докторској дисертацији:

Назив дисертације: Статистичка теорија узрочности, стохастичке диференцијалне  
једначине и својство мартингалне репрезентације  
Научна област УДК(текст): 51 (математичке науке)

Ментор и састав комисије за оцену дисертације:

1. др Љиљана Петровић (ментор), редовни професор Економског факултета у Београду,  
ужа научна област: Статистика и математика,
2. др Светлана Јанковић, редовни професор Природно-математичког факултета у Нишу,  
ужа научна област: Стохастичка анализа са применама
3. др Дејан Бојовић, ванредни професор Природно-математичког факултета у  
Крагујевцу, ужа научна област: Математичка анализа са применама

Главни допринос дисертације (текст до 100 речи): У дисертацији су анализирани  
различити концепти узрочности који су уопштења Гренцерове дефиниције узрочности у  
непрекидном случају. Показано је да се под одређеним релацијама узрочности чува  
својство мартингалности за случајне процесе. Резултати су проширени на локалне  
мартингале, семимартингале и квазимартингале. Дати концепт статистичке узрочности је  
еквивалентан појму ортогоналности мартингала, како слабе тако и јаке ортогоналности.

Разматране су везе између узрочности и мартингалних репрезентација које имају  
битну улогу у финансијској математици. Показано је да је својство мартингалне  
репрезентације слабих решења стохастичких диференцијалних једначина генерисаних  
семимартингалима, еквивалентно са концептом сопствене узрочности. Добијени  
резултати су примењени и на мартингални проблем придружен датој једначини.

**ПОДАЦИ О КАНДИДАТУ**

Презиме и име кандидата: Ваљаревић Драгана (рођ. Станојевић)

Назив завршеног факултета: Природно-математички факултет у Косовској Митровици

Одсек, група, смер: Математика

Година дипломирања: 2000.

Назив магистарског рада, односно докторског студијског програма: *Узрочност и слаба  
решења стихастичких диференцијалних једначина*

Научно подручје: Теорија вероватноће

Година одбране: 2006.

Факултет и место: Природно-математички факултет у Крагујевцу

Број публикованих радова: 4 рада из области дисертације

1. Petrović Lj., Stanojević D.: *Some Models of Causality and weak Solutions of Stochastic*

*Differential Equations driven by Semimartingales*, Facta. Univ. Ser. Math. Inform. 20, pp. 103-112, (2005). (ISSN 0352-9665; **M51**)

2. Petrović Lj., **Stanojević D.**: *Statistical Causality, Extremal Measures and Weak Solutions of Stochastic Differential Equations With Driving Semimartingales*, J.Math.Model.Algor, (2010), 9, pp.113-128. (ISSN: 1570-1166; **M53**)

3. **Valjarević D.**, Petrović Lj.: *Statistical causality and orthogonality of local martingales*, Statist. Probab. Lett. **82** (2012), 1326-1330. (ISSN 0167-7152; **M23**)

4. Petrović Lj., **Valjarević D.**: *Statistical causality and stable subspaces of  $H^p$* , Bull. Aust. Math. Soc., doi: 10.1017/S0004972712000482, (2012). (ISSN: 0004-9727; **M23**)

Назив и седиште организације у којој је кандидат запослен: Природно-математички факултет у Косовској Митровици  
Радно место: асистент

**ПОТВРЂУЈЕМО ДА КАНДИДАТ ИСПУЊАВА УСЛОВЕ УТВРЂЕНЕ ЧЛ. 30 ЗАКОНА  
О ВИСОКОМ ОБРАЗОВАЊУ И ЧЛ. 48 СТАТУТА УНИВЕРЗИТЕТА  
У КРАГУЈЕВЦУ**

У прилогу вам достављамо: - Извештај комисије о оцени урађене докторске дисертације;  
- Одлуку научно-наставног већа факултета о прихватању извештаја комисије о урађеној докторској дисертацији

\_\_\_\_\_ (место и датум)  
\_\_\_\_\_



М.П.

ДЕКАН \_\_\_\_\_ ФАКУЛТЕТ

*[Handwritten signature]*