

## Спецификација предмета за књигу предмета

Студијски програм		Примењена статистика			
Назив предмета		Финансијски модели			
Наставник (за предавања)		Наташа Крејић, Ненад Вуњак, Отилија Седлак, Небојша Гвозденовић			
Наставник/сарадник (за вежбе)		Зоранка Десница			
Број ЕСПБ	8	Статус предмета (обавезни/изборни)		изборни	
Услов					
Циљ предмета					Циљ предмета је упознавање студената са теоријом каматних стопа, финасијским моделима и дериватима.
Исход предмета					Студент ће стећи функционално знање и биће оспособљен за примену финансијских модела у реалним ситуацијама. Стећи ће способност процене ризика.
Садржај предмета					
Теоријска настава					Основна теорија каматних стопа и терминска структура каматних стопа Финансијски модели: очекивање-принос теорија портфолиа, CAPM, факторски модели, функције корисности) Финансијски деривати. Опције: биномни модели, непрекидни модели. Мере ризика: VaR и CVar
Практична настава					Задачи и проблеми који се решавају на практичној настави прате садржај предавања, тј. теоријске наставе. Коришћење статистичког софтвера
Литература					
1					D.G. Luenberger, Investment Science, Oxford University Press 1998
2					Jorion, P. and GARP, Financial Risk Manager Handbook ,
3					Cuthbertson, K., Nitzsche, D Financial Engineering: Derivatives and Risk Management,
4					J.C.Hull, Options, Futures and Other Derivatives, Prentice Hall, 2003
5					J. C. Vitanić, F. Zapatero, Economics and Mathematics of Financial Markets, The MIT Press, 2004
Број часова активне наставе недељно током семестра/триместра/године					
Предавања	Вежбе	ДОН	Студијски истраживачки рад		Остали часови
3	2	----	-----		-----
Методе извођења наставе					предавања, вежбе, анализа примера са применама, писање извештаја о обављеним статистичким анализама
Оцена знања (максимални број поена 100)					
Предиспитне обавезе		поена	Завршни испит		поена
активност у току предавања		5	испит		40
практична настава		5			
колоквијуми		30			
семинари		20			