

**Табела 5.2. Спецификација предмета**  
 Спецификацију треба дати за сваки предмет из студијског програма.

<b>Студијски програм:</b> Основне академске студије МАТЕМАТИКА			
<b>Назив предмета:</b> Финансијско моделовање			
<b>Наставник/наставници:</b> Миљан Кнежевић, Бојана Милошевић			
<b>Статус предмета:</b> изборни			
<b>Број ЕСПБ:</b> 5			
<b>Услов:</b>			
<b>Циљ предмета:</b> Стицање основних знања из финансијске математике.			
<b>Исход предмета:</b> По завршетку курса студент може самостално да се бави финансијском анализом.			
<b>Садржај предмета</b>			
<i>Теоријска настава</i>			
Моделирање криве приноса. Моделирање калкулатора за рачунање цена одређених финансијских инструмената. Опције - биномни модел. Вар анализа. Селекција оптималног портфолија. Хеџовање (делта хеџинг). Анализа утицаја варијансе. ARCH и GARCH модели и предикције. Креирање сопственог солвера.			
<i>Практична настава</i>			
<b>Литература:</b>			
1. Lionel Martellini, Philippe Priaulet, and Stphane Priaulet, Fixed-Income Securities: Valuation, Risk Management and Portfolio Strategies, The Wiley Finance Series, 2003.			
2. Michael Rees, Financial Modelling in Practice, 2021.			
<b>Број часова активне наставе:</b> 4	<b>Теоријска настава:</b> 2	<b>Практична настава:</b> 2	
<b>Методе извођења наставе:</b> фронтални, групни и практични.			
<b>Оцена знања (максимални број поена 100)</b>			
<b>Предиспитне обавезе</b>	поена	<b>Завршни испит</b>	поена
активност у току предавања		писмени испит	30
практична настава	40	усмени испит	30
колоквијум-и		.....	
семинар-и			
Начин провере знања могу бити различити наведено у табели су само неке опције: (писмени испити, усмени испит, презентација пројекта, семинари итд.....			
*максимална дужина 2 странице А4 формата			