

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

Студијски програм: Основне академске студије МАТЕМАТИКА			
Назив предмета: Увод у финансијску математику			
Наставник/наставници: Миљан Кнежевић, Бојана Милошевић, Марек Светлик			
Статус предмета: обавезни (модул Професор математике и рачунарства) и изборни (модул Теоријска математика и примене, модул Математика и рачунарство, модул Примењена математика)			
Број ЕСПБ: 5			
Услов:			
Циљ предмета: Стицање основних знања из финансијске математике.			
Исход предмета: По завршетку курса, студент има основна знања из финансијске математике. Упознат је са основним појмовима и моделима у финансијама. Може самостално, да у оквиру постојећег модела, изводи закључке. Оспособљен је да прати напредније курсеве из финансијске анализе и моделовања.			
Садржај предмета			
<i>Теоријска наставна</i>			
Финансијска тржишта – механизми;			
Вредновање пројеката – НПВ, ИРР;			
Дужнички инструменти;			
Моделовање криве приноса;			
Финансијски деривати - опције, свопови;			
Биномни модел одређивања цена опција - увод у Блек-Шолов модел;			
Заштита од губитка вредности (хеџовање);			
САРМ модел;			
Арбитража.			
<i>Практична наставна</i>			
Литература:			
Lionel Martellini, Philippe Priaulet and Sthpane Priaulet, Fixed-Income Securities: Valuation, Risk Management and Portfolio Strategies, The Wiley Finance Series, 2003.			
Број часова активне наставе: 4		Теоријска настава: 2	Практична настава: 2
Методе извођења наставе: фронтални, практични.			
Оцена знања (максимални број поена 100)			
Предиспитне обавезе		Поена	Завршни испит
активност у току предавања			писмени испит
практична настава		40	усмени испит
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			