

Студијски програм: Основне академске студије ИНФОРМАТИКА			
Назив предмета: Увод у финансијску математику			
Наставник/наставници: Миљан Кнежевић, Бојана Милошевић, Марек Светлик			
Статус предмета: изборни			
Број ЕСПБ: 5			
Услов: Нема услова			
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 настава</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 настава</i>			
Литература:			
1. Lionel Martellini, Philippe Priaulet and Stphane 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
Методe извођења наставе: фронтални, практични.			
Оцена знања (максимални број поена 100)			
Предиспитне обавезе	Поена	Завршни испит	поена
активност у току предавања		писмени испит	30
практична настава	40	усмени испит	30
колоквијум-и			
семинар-и			