

<b>Студијски програм :МБ</b>			
<b>Назив предмета: Финансијска математика 2 (МБ11)</b>			
<b>Наставник: др Наташа Крејић</b>			
<b>Статус предмета: изборни</b>			
<b>Број ЕСПБ:8</b>			
<b>Услов:</b>			
<b>Циљ предмета</b>			
Циљ предмета је увођење концепта математичког моделирања као важног алата у финансијама. Сврха је усвајање знања потребног за разумевање модела портфолио анализе и модела за вредновање финансијских деривата и развој способности за математичко моделирање у финансијама.			
<b>Исход предмета</b>			
Студенти ће савладати примену модела ризика на стварне податке, интерпретацију резултата и биће оспособљени да вреднују сложене финансијске инструменте.			
<b>Садржај предмета</b>			
<i>Теоријска настава</i>			
<i>Анализа портфолио варијансе. CAP модел. APT модел. Функције корисности. Arrow-Debreu хартије од вредности. Финансијски деривати, форварди, фјучерси ии опције. Биномни модел вредновања опција. Непрекидни модел вредновања опција - Black – Scholes формула. VaR и CVar. кохерентне мере ризика.</i>			
Practical instruction: Practical exercises based on theoretical instructions. The exercises are performed at blackboard as well as using software.			
<i>Практична настава. Заснована на теоријској настави. Вежбе се изводе на табли и на рачунару.</i>			
<b>Литература</b>			
1. Luenberger, Investment Science, Oxford University Press, New York, 1997.			
2. J.C. Hull, Options, Futures and Other Derivatives, Prentice Hall, 2003			
3. Roman, Steven: Introduction to the Mathematics of Finance. Springer-Verlag, New York [etc.], 2004.			
4. Cvitanic, J., Zapaterro, F., Introduction to the Economics and Mathematics of Financial Markets, MIT Press, 2004.			
<b>Број часова активне наставе</b>	<b>Теоријска настава:4</b>	<b>Практична настава:2</b>	
<b>Методe извођења наставе</b>			
предавања, вежбе на табли, вежбе на рачунару, самостални рад студената			
<b>Оцена знања (максимални број поена 100)</b>			
<b>Предиспитне обавезе</b>	поена 50	<b>Завршни испит 50</b>	поена
активност у току предавања		писмени испит	
колоквијум-и	50	.....	