



УНИВЕРЗИТЕТ У ИСТОЧНОМ САРАЈЕВУ  
ФАКУЛТЕТ ПОСЛОВНЕ ЕКОНОМИЈЕ БИЈЕЉИНА



Студијски програм: Финансије, банкарство и осигурање

<b>Назив предмета</b>	Финансијско математичка анализа			
<b>Катедра којој предмет припада</b>	Катедра за квантитативну економију			
<b>Шифра предмета</b>	<b>Статус предмета</b>	<b>Семестар</b>	<b>Фонд часова</b>	<b>Број ECTS бодова</b>
FB-01-2-007-2	Изборни	I	3+1	6
<b>Наставник</b>	Проф. др Јелена Кочовић, Проф. др Мирела Митрашевић			
<b>Сарадник</b>				
<b>Условљеност другим предметима</b>			<b>Облик условљености</b>	
Нема условљености				
<b>Циљеви изучавања предмета:</b>				
Главни циљ предмета је да студенту пружи сложена знања из области одређивања цијена инструмената на свим сегментима финансијских тржишта. При томе посебна пажња ће бити посвећена различитим врстама каматних стопа као и временској структури и управљању ризиком каматне стопе. Студенти ће бити оспособљени за обављање сложених портфолио послова у банкама, на берзи, у осигуравајућим компанијама и другим финансијским институцијама у циљу најпрофитабилнијег улагања средстава.				
<b>Исходи учења :</b>				
Способност спровођења одређених финансијскио математичких анализа. Посебно уважавајући у тим анализама временску димензију новца, студенти ће бити у прилици да овладају различитим способностима, знањима и вјештинама у обављању сложених портфолио послова у банкама и другим финансијским институцијама.				
<b>Садржај предмета:</b>				
1. Временска вриједност новца. 2. Временска структура каматне стопе. 3. Управљање ризиком каматне стопе. 4. Утврђивање цијенадисконтних и каматноносних хартија од вриједности. 5. Финансијско математички обрачуни на ломбардном, хипотекарном и девизном тржишту. 6. Финансијско математички обрачуни на кредитном и есконтном тржишту. 7. Обрачуни у лизингу и форфетингу. 8. Модели утврђивања цијена акција и модели утврђивања цијена обвезница. 9. Дурација, модификована дурација и конвексност. 10. Методе утврђивања ефикасности инвестиција у условима извјесности. 11. Методе утврђивања ефикасности инвестиција у условима ризика. 12. Методе утврђивања ефикасности инвестиција у условима ризика. 13. Обрачуни на тржишту деривата (фјучерси, форвардси и опције). 14. Обрачуни на тржишту деривата (фјучерси, форвардси и опције). 15. Портфолио осигуравајућих компанија.				
<b>Методе наставе и савладавање градива:</b>				
Предавања, израда задатака, анализа проблема из праксе, дискусије, презентације, семинарски радови, тестови итд.				

**Литература:**

1. Кочовић Ј. Финансијска математика Центар за издавачку делатност, Економски факултет, Београд, 2006
2. Кочовић Ј. Finansovaja matematika Finansii i statistika 2004
3. Steiner R. Mastering financial calculations Prentice Hall 1999
4. Castagnoli E., Peccati L. Financial calculus with applications Bokonі 2002
5. Gerber H. Life insurance mathematics 3rd-ed Springer, Swiss Association of Actuaries 1997
6. Barnett R., Ziegler M., Byleen K. Finite mathematics (for business, economics, lifesciences and social sciences) Prentice Hall 2005
7. Četirkin E. Finansovaja matematika Izdatelstvo Delo 2003

**Облици провјере знања и оцјењивање:**

Коначна оцјена на испиту добија се на основу активног учешћа у наставном процесу, позитивно оцјењених семинарских радова и колоквијума и знања показаног на усменом и практичном дијелу испита.

Похађање наставе	5	Колоквијуми	40	Завршни испит	50
Активност на настави	5	Семинарски		Лабораторија	

**Посебна назнака за предмет:**

**Име и презиме наставника који је припремио податке:** Проф. др Јелена Кочовић

**Датум овјере:** 14.11.2016.