

Студијски програм: ДАС - МАТЕМАТИКА			
Назив предмета: Елементи финансијске математике			
Наставник: Слободанка Јанковић			
Статус предмета: Изборни за модул Статистика, актуарска и финансијска математика			
Број ЕСПБ: 8			
Услов: Теорија вероватноће, Случајни процеси			
Циљ предмета: Стицање знања о основним и изведеним финансијским инструментима, као и о стохастичким методама које се користе у моделирању цена финансијских инструмената у дискретном времену..			
Исход предмета: Студент је оспособљен да решава задатке који се односе на моделирање цена финансијских инструмената.			
Садржај предмета: Каматне стопе, обвезнице, акције. Секундарни финансијски инструменти. Моделирање цена у дискретном времену, биномни модели. Моделирање цена финансијских деривата.			
Литература:			
1. J.C. Hull: <i>Options, Futures, and Other Derivatives</i> , Prentice Hall, 2006.			
2. А.Н. Ширяев: <i>Основы стохастической финансовой математики</i> , Фазис, Москва, 1997.			
3. Howard M. Taylor and Samuel Karlin, <i>An Introduction to Stochastic Modeling</i> , Academic Press, 1998.			
Број часова активне наставе: 7	Теоријска настава: 3	Практична настава: 4	
Методе извођења наставе: Фронтални, групни и практични			
Оцена знања (максимални број поена 100)			
Предиспитне обавезе	поена	Завршни испит	поена
активност у току предавања		писмени испит	
практична настава	10	усмени испит	40
колоквијум-и	40		
Семинарски радови	10		