

Teme za seminarske radove

1. Optimizacija portfolija zasnova na EVaRu
Literatura
2. Robustna optimizacija portfolija
Literatura
3. Hibridni Monte Karlo metod za vrednovanje Azijskih opcija
Literatura
4. Optimizacija portfolija zasnovana na CVaR-u u modelu sa asimetričnom Laplasovom raspodelom
Literatura
5. Binarne opcije i njihovo vrednovanje
Literatura
6. Monte Karlo metod za vrednovanje Američkih opcija
Literatura
7. Vrednovanje kreditnih swapova
Literatura
8. Bino-trinomni model za odredjivanje cena opcija
Literatura
9. Ocenjivanje volatilnosti u Black-Scholes modelu
Literatura: Nicolas Privault, Notes on Stochastic Finance
10. Bajesovski pristup za optimizaciju portfolija 1
Literatura
11. Bajesovski pristup za optimizaciju portfolija 2
Literatura
12. Optimizacija portfolija zasnovana na merama divergencije
Literatura
13. Testovi normalnosti kao dijagnostički testovi u vremenskim serijama u finansijama
14. Upoređivanje dve metode za ocenu parametara u Blek-Šolšovom modelu
Literatura
15. "Variance-Gamma Model" i njegova primena
Literatura 1
Literatura 2

16. Simulacija "Variance-Gamma" modela

Literatura

17. Vasičekov model

Literatura: 13.1, 13.2

18. Hiperbolični Levijev model

Literatura

19. Vrednovanje Azijskih opcija

Literatura

20. Primena butstrepa za optimizaciju portfolija

Literatura

21. Kriptovalute

Predložiti konkretniju temu uz predlog literature na mazaupc@gmail.com

Za izradu seminarskog rada potrebno je izabrati neku od navedenih tema i javiti na mejl btodic@matf.bg.ac.rs.

Studenti osnovnih studija rade seminarski rad u grupama od 2-3 studenta, a studenti master studija rade samostalno ili u parovima.

Rad u pdf formatu poslati na mejlove mazaupc@gmail.com i btodic@matf.bg.ac.rs (oba), nakon čega će biti dogovorena odbrana seminarskog rada.

Rok za predaju seminarskog rada je: 15. maj 2019.

Odbrane će biti realizovane do kraja semestra.