



ДОКУМЕНТАЦИЈА ЗА АКРЕДИТАЦИЈУ СТУДИЈСКОГ ПРОГРАМА
ДРУГОГ СТЕПЕНА ВИСОКОГ ОБРАЗОВАЊА

Стандард 5: Курикулум

Табела 5.2. Спецификација предмета
– Шифра: МС - 537

| | | | |
|---|--------------|--|---------------|
| Студијски програм/студијски програми: Финансије, банкарство и осигурање, Европска и међународна економија и бизнис | | | |
| Врста и ниво студија: Студије другог степена - Мастер академске студије | | | |
| Назив предмета: Статистика и економетрија финансијских тржишта | | | |
| Наставник (Презиме, средње слово, име): Киш Ш. Тибор | | | |
| Статус предмета: изборни | | | |
| Број ЕСПБ: 6 | | | |
| Услов: није постављен | | | |
| Циљ предмета: Упознавање студената са основним појмовима и методима финансијске статистичке и економетријске анализе; пажња се посвећује основним карактеристикама стохастичности финансијских временских серија; пружају се знања у области формулисања, оцењивања, тестирања и интерпретације модела финансијских временских серија различитих типова. | | | |
| Исход предмета: Овладавање знањима у области финансијске економетрије статистичке анализе финансијских тржишта и оспособљеност студената за самостална квантитативна испитивања различитих економских повезаности финансијских варијабли у циљу пружања подршке у процесима доношења пословних одлука. | | | |
| Садржај предмета <i>Теоријска настава</i> Стохастички процеси и финансијске временске серије; Модерна и постмодеррна портфолио теорија; Модели вредновања опција (Black-Scholes, биномијални и тринوميјални модели, егзотичне опције); Економетријски модели финансијских временских серија (CAPM, Паритет курсева девиза, Cox-Ingersoll-Ross модел, Тржишна цена ризика, Арбитражна теорија вредновања); Вредновање и контрола ризика портфолија (VaR модели, Моделирање екстремног ризика). <i>Вежбе</i> Статистичка анализа на финансијском тржишту; Моделирање финансијских временских серија применом ARIMA модела; финансијске временске серије са стохастичким варијацијама (ARCH и GARCH модели); Коинтеграција финансијских временских серија; Обрада студија случаја у рачунарској лабораторији. | | | |
| Литература Киш, Т., (2008), Статистика и економетрија финансијских тржишта, Компендијум Franke J. et al., (2004), Statistics of Financial Markets, Springer, Berlin McAleer M., Oxley L., ed. (2002), Contributions to Financial Econometrics, Blackwell, Oxford Jorion P., (1997), Value at Risk, The New Benchmark for Controlling Derivatives Risk, McGraw-Hill, Boston Wang, P., (2003), Financial Econometrics, Routledge, London | | | |
| Број часова активне наставе у 1. семестру | | | Остали часови |
| Предавања: 30 | Вежбе: 30 | Други облици наставе: Студијски истраживачки рад: | |
| Методе извођења наставе: предавања, вежбе, дискусије о методима формулисања модела и економске интерпретације резултата моделирања, обрада студија случаја у рачунарској лабораторији | | | |
| Оцена знања (максимални број поена 100) | | | |
| Предиспитне обавезе | поена | Завршни испит | поена |
| активности у току предавања | 2 | писмени испит | 30 |
| колоквијуми: 2 | 52 | усмени испит | |
| домаћи задаци: 2 | 4 | | |
| семинарски рад: 2 | 6 | | |
| студија случаја у рачунарској лабораторији: 1 | 6 | | |
| СВЕГА | 70 | | 30 |