

Diplomski studij <b>POSLOVNA EKONOMIJA</b> Studijski smjerovi: <b>Financijski management, Računovodstvo i revizija</b>				Godina: 1	Semestar: 2	Status: <b>obv./izb.</b>		
Kod: <b>EUB320</b>		Naziv predmeta: <b>Financijsko modeliranje</b>		ECTS: 5	Strani jezik: Engleski			
Nastavnici: <b>prof. dr. sc. Zdravka Aljinović</b>								
Asistenti: <b>mr.sc. Branka Marasović</b>								
Tjedan	Predavanja		Vježbe		Zadaci za samostalni rad i kontinuiranu provjera znanja			
	Tema	Sati	Tema	Sati	Oblik rada	U okviru satnice	Ocjena	Kumul. ocjena
1	Temeljni pojmovi moderne teorije portfelja, očekivana vrijednost i varijanca portfelja, matrica varijanci i kovarijanci	2	Temeljni pojmovi moderne teorije portfelja, očekivana vrijednost i varijanca portfelja, matrica varijanci i kovarijanci	2		<input type="checkbox"/>	%	%
2	Teorijske postavke Markowitzevog modela, skup minimalne varijance, efikasni portfelj, efikasna granica-dozvoljena kratka prodaja	2	Teorijske postavke Markowitzevog modela, skup minimalne varijance, efikasni portfelj, efikasna granica-dozvoljena kratka prodaja	2		<input type="checkbox"/>	%	%
3	Efikasna granica-nije dozvoljena kratka prodaja CAPM, Procjena sistemskog rizika (beta), testiranje CAPM-a.	2	Efikasna granica-nije dozvoljena kratka prodaja CAPM, Procjena sistemskog rizika (beta), testiranje CAPM-a.	2		<input type="checkbox"/>	%	%
4	Rizičnost vrijednosti (Value at Risk-VaR) - definicija, svojstva VaR-a kao mjere rizika, VaR dionice, VaR portfelja	2	Rizičnost vrijednosti (Value at Risk-VaR) - definicija, svojstva VaR-a kao mjere rizika, VaR dionice, VaR portfelja	2	Test - Excel	da <input type="checkbox"/>	1/6	1/6
5	Opcije-temeljni pojmovi, Temeljna svojstva cijene opcije	2	Opcije-temeljni pojmovi, Temeljna svojstva cijene opcije	2	Test (teorija)	da <input type="checkbox"/>	1/6	2/6
6	Novčani tijekovi i profit kod opcija: zadržavanje duge i kratke pozicije do dospijea opcije, hedging, spread, straddle	2	Novčani tijekovi i profit kod opcija: zadržavanje duge i kratke pozicije do dospijea opcije, hedging, spread, straddle	2		<input type="checkbox"/>	%	%
7	Propozicije o graničnim vrijednostima opcija	2	Propozicije o graničnim vrijednostima opcija	2		<input type="checkbox"/>	%	%
8	Binomni model vrednovanja opcija	2	Binomni model vrednovanja opcija	2		<input type="checkbox"/>	%	%
9	Black-Scholesov model vrednovanja opcija	2	Black-Scholesov model vrednovanja opcija	2		<input type="checkbox"/>	%	%
10	Analiza osjetljivosti cijene opcije-Grci	2	Analiza osjetljivosti cijene opcije-Grci	2	Test - Excel	da <input type="checkbox"/>	1/6	3/6
11	Trajanje obveznice - pojam, računanje i značenje		Trajanje obveznice - pojam, računanje i značenje	2	Test (teorija)	da <input type="checkbox"/>	1/6	4/6
12	Imunizacija portfelja obveznica	2	Imunizacija portfelja obveznica	2		<input type="checkbox"/>	%	%
13	Vremenska struktura kamatnih stopa, krivulja prinosa, forward kamatna stopa	2	Vremenska struktura kamatnih stopa, krivulja prinosa, forward kamatna stopa	2		<input type="checkbox"/>	%	%
14	Vasicekov model, procjena krivulje prinosa	2	Vasicekov model, procjena krivulje prinosa	2				
15	Ponavljanje gradiva i priprema za ispit ili predavanja gostujućeg profesora na temu modela financiranja	2	Ponavljanje gradiva i priprema za ispit ili predavanja gostujućeg profesora na temu modela financiranja	2	Test - Excel Test (teorija)	da <input type="checkbox"/>	2/6	1

**Literatura:**

1) Aljinović, Z., B. Marasović, B. Šego, *Financijsko modeliranje*, Zgombić&Partneri, Zagreb, 2008.

Dodatna literatura:

1) Tomić-Plazibat, N., Z. Aljinović, B. Marasović, *Matematički modeli u financijskom upravljanju*, Ekonomski fakultet Sveučilišta u Splitu, Split, 2006.

2) Benninga, S., *Financial modeling*, The MIT Press, Cambridge, 2000

3) Hull, J.C., *Options, Futures and other derivative securities*, 6th ed, Prentice Hall, New Jersey, 2006

Napomene:

Termini ispita bit će definirani kalendarom ispita.

Vježbe se održavaju na računalu gdje se kompletno gradivo uvježbava pomoću tabličnog kalkulatora Excel.

Uvjeti za potpis: 80% pohađanja nastave (predavanja i vježbi) i dokumentirane sve vježbe.

Studenti koji polože sve testove oslobođeni su polaganja ispita.

Pismeni dio ispita provodi se na računalu.

Gostujući profesor: prof. dr. sc. Boško Šego s Ekonomskog fakulteta-Zagreb