



Катедра за

Управљање системима и

Електронско пословање

Лабораторија за системе

Теорија система 2

VIII семестар

Тематске целине:

- Увод у берзанска тржишта
- Анализа временских серија - основни концепти
- Основни модели временских серија
- Основни квантитативни концепти у финансијама
- Fixed-income securities
- Финансијски деривати

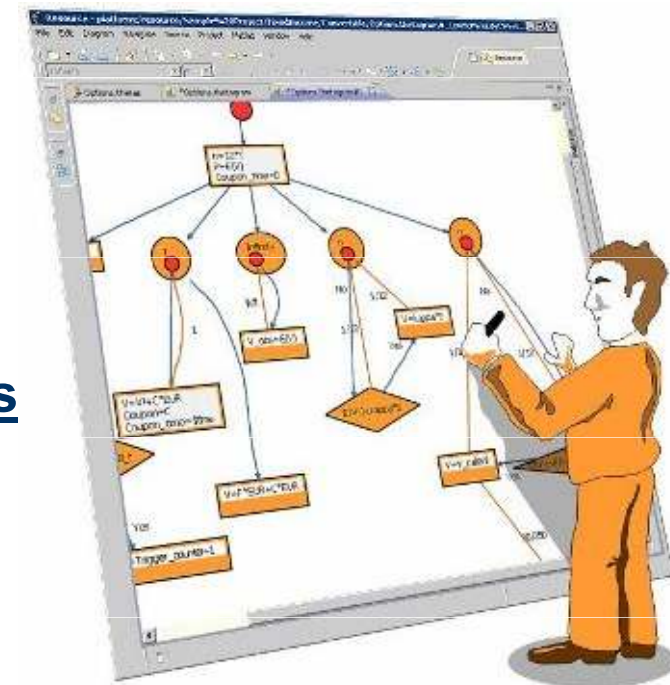


Предавања:

- Проф. др Братислав Петровић, bratislav.petrovic@fon.rs

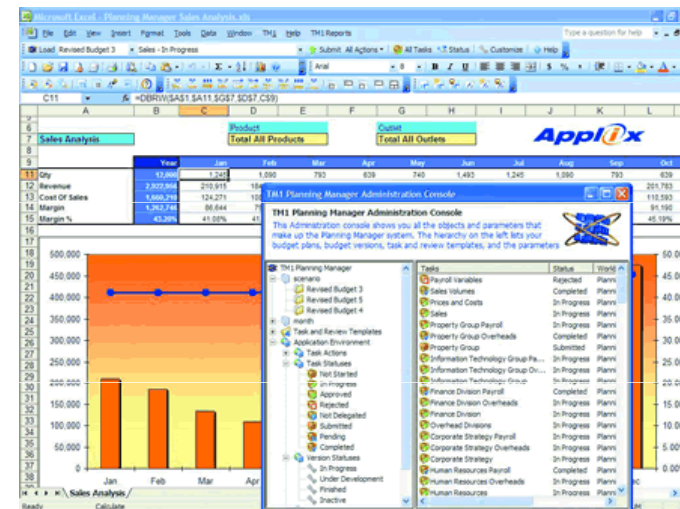
Вежбе/Лабораторијске вежбе:

- Ана Поледица, aroledica@fon.rs
- Александар Ракићевић, arakicevic@fon.rs



Начин полагања:

- Предиспитне обавезе:
 - Предавање и вежбе,
 - Домаћи задаци и истраживачки задаци,
 - Виртуелна игра на берзи.
- Испит се полагаје путем:
 - Тест,
 - Семинарски радови.



Литература:

- **Analysis of Financial Time Series – Ruey S. Tsay, John Wiley & Sons, 2005.**
- **Options Futures and Other Derivative Securities – Hull J.C., Prentice Hall 5th ed 2002**
- **Introduction to the Economics and Mathematics of Financial Markets – Cvitanic J. Zapatero F., MIT Press 2004.**
- **Fixed-Income Securities Valuation, Risk Management and Portfolio Strategies – Martellini L., Priaulet P. and Priaulet S., Wiley, 2003.**