

Табела 5.1 Спецификација предмета на студијском програму докторских студија

Назив предмета: Квантитативне методе у економији		
Наставник или наставници (презиме, средње слово име): Обрад Д. Тодоровић , Ђорђевић Б. Вера , Миљивоје Д. Пешић		
Статус предмета: изборни		
Број ЕСПБ: 10		
Услов:		
Циљ предмета Проширити и продубити знање основних статистичких и економетријских метода. Упознати студенте са теоријским основама и практичном анализом економских појава, са акцентом на анализом ризика у финансијским институцијама и тржишту хартија од вредности. Оспособити студенте за целовиту статистичко-економску анализу, у циљу одабира одговарајућих статистичких метода, обраде података и презентовање добијених резултата.		
Исход предмета Актуелна знања и вештине за: а) Примену одабраних метода и модела за доношење пословних одлука, упознавање са методаима симулације експериментисањем и употребом истих в) коришћење одговарајућих софтверских пакета, г) самостално спровођење једноставнијих статистичких истраживања у економији и бизнису.		
Садржај предмета 1. Анализа временских серија <ul style="list-style-type: none"> ▪ Општи појмови у анализи временских серија ▪ Дескриптивне методе у анализи временских серија ▪ Модели стационарних временских серија ▪ Модели нестационарних временских серија ▪ Изградња АРИМА модела ▪ Сезонски модели временских серија ▪ Специфичности у анализи временских серија 2. Прогнозирање економских процеса <ul style="list-style-type: none"> ▪ Увод у прогнозирање економских процеса ▪ Прогнозирање на основу простог линеарног регресионог модела ▪ Прогнозирање на основу временских серија 3. Симулациони модели: историјски, параметарски и Monte Carlo симулација 4. Monte Carlo симулација <ul style="list-style-type: none"> ▪ Могућности примене Monte Carlo симулације ▪ Основни модели Monte Carlo методе ▪ Анализа ризика на финансијском тржишту Monte Carlo симулацијом 5. Модели вредновања <ul style="list-style-type: none"> ▪ Вредновање инвестиционих пројеката <ul style="list-style-type: none"> ▪ Дефинисање циљева проблема ▪ Формирање модела ▪ Вредновање хартија од вредности <ul style="list-style-type: none"> ▪ Структура проблема ▪ Ценовни VS вредносни приступ ▪ Оптимизација портфолиа хартија од вредности ▪ DCF (Discounted Cash Flow) анализа ▪ Врсте DCF (Discounted Cash Flow) метода <ul style="list-style-type: none"> ▪ FTE (Flows To Equity) приступ ▪ APV (Adjusted Present Value) приступ ▪ WACC (Weighted Average Cost of Capital) приступ ▪ TCF (Total Cash Flow) приступ 		
Препоручена литература 1.З.Ковачић, „Анализа временских серија“, Економски факултет, Београд, 1998.год. 2.М. Арсић, З. Младеновић, А. Нојковић и П. Петровић, <i>Маркоконометријско моделирање привреде Србије –теоријске основе и резултати</i> , CES MECON, Београд 2005. 3. А.Н. Studenmund, <i>Using Econometrics – A practical Guide</i> , Pearson International Edition, 2006. 4.М. Wisniewski, <i>Quantitative Methods for Decision Makers</i> , Prentice Hall, 2006. 5.Dennis Cox, Michael Cox, <i>The Mathematics of Banking and Finance</i> , John Willey and Sons, New York, 2006. 6.Ngai Hang Chan, <i>Time Series</i> , John Willey and Sons, New York, 2006. 7. Devid Ruppert, <i>Statistics and Finance</i> , Springer, 2006. 8. John C. Hull, <i>Risk Management for Financial Institutions</i> , Prentice Hall, 2006.		
Број часова активне наставе 120	предавања: 45	Студијски истраживачки рад: 75
Методе извођења наставе Презентације и анализе конкретних примера из праксе, излагање семинарских радова		
Оцена знања (максимални број поена 100)		
<ul style="list-style-type: none"> - предавања: 20 - семинарски рад: 30 - испит: 50 		