

Студијски програм/студијски програми : Финансијски менаџмент, контрола и менаџерско рачуноводство				
Врста и ниво студија: Мастер академске студије				
Назив предмета: Симулација у финансијском одлучивању				
Наставник: Марковић М. Александар, Јеремић М. Вељко, Зорнић З. Никола, Обрадовић А. Тијана				
Статус: Изборни				
Број ЕСПБ: 9				
Услов: /				
Циљ предмета Да студенти овладају техникама моделирања у <i>spreadsheet</i> програмима, да се оспособе за израду комплексних финансијских <i>spreadsheet</i> модела, да схвате значај коришћења симулационих модела у финансијском одлучивању, да стекну знања у области примене <i>Monte Carlo</i> симулације у решавању финансијских проблема, да науче на који начин је могуће користити разноврсне симулационе моделе у анализи финансијских проблема и доношењу одлука.				
Исход предмета Самостална изградња и коришћење <i>spreadsheet</i> симулационих модела у финансијском одлучивању, овладавање техникама напредног <i>spreadsheet</i> моделирања, способност да користе моделе за доношење одлука у области финансијског менаџмента и у управљању финансијским ризицима.				
Садржај предмета <i>Теоријска настава</i> Примена модела у финансијама; улога и значај финансијских модела. Моделирање у <i>spreadsheet</i> програмима – напредне технике. Симулација у <i>spreadsheet</i> програмима. Анализа осетљивости у <i>spreadsheet</i> програмима. Моделирање стохастичких финансијских проблема. Коришћење симулационих резултата у анализи финансијских проблема. Напредно коришћење <i>add-in</i> програма за <i>spreadsheet</i> моделе. Бројне примене <i>spreadsheet</i> финансијских модела у пракси. <i>Практична настава</i> Напредне технике <i>spreadsheet</i> моделирања – <i>Microsoft Excel</i> . Развој и изградња комплексних <i>spreadsheet</i> модела: Модел за утврђивање вредности акција на берзи; Примена <i>Solver & Goalseek</i> модула у анализи осетљивости; Модел за корпоративно финансијско планирање; Модел за анализу портфолија. Модел одређивања вредности улагања под ризиком – <i>VaR</i> . Примена <i>Black Scholes</i> модела у финансијама. <i>Spreadsheet</i> модели у управљању инвестицијама; Модел за анализу ризика применом <i>Monte Carlo</i> симулације у софтверу <i>@RISK</i> . Модел за симулацију и оптимизацију у финансијама у софтверу <i>@RISK</i> .				
Литература Benninga S: Financial Modeling, MIT Press, Cambridge, Massachusetts, 2008. Chan N.H, Wong H.Y. Handbook of Financial Risk Management: Simulations and Case Studies (Vol. 12). John Wiley & Sons, 2013. Pachamanova D. A, Fabozzi F.J. Simulation and Optimization in Finance: Modeling with MATLAB, @ RISK, or VBA. John Wiley & Sons, 2010. Palisade Corporation: Guide to Using @RISK, Risk Analysis and Simulation Add-In for Microsoft Excel. Proctor K.S: Building financial models with Microsoft Excel: A Guide for Business Professionals. John Wiley & Sons, Hoboken, New Jersey, 2010. Rees M: Financial Modelling in Practise: A Concise Guide for intermediate and Advanced Level, John Wiley & Sons, West Sussex, 2008. Radenković B, Stanojević M, Marković A: Računarska simulacija, FON i Saobraćajni fakultet, udžbenik, Beograd, 2010				
Број часова активне наставе				Остали часови 1
Предавања: 2	Вежбе 2	Други облици наставе: /	Студијски истраживачки рад: 4	
Методe извођења наставе Интерактивна настава ће обухватити предавања, семинаре, вежбе на рачунару, рад у мањим групама, индивидуални рад и завршни семинарски рад.				
Оцена знања (максимални број поена 100)				
Предиспитне обавезе	Поена	Завршни испит	поена	
Активност у току предавања	10	Усмени испит	50	
Израда семинарског рада	40			