

NAZIV PREDMETA	Financijski praktikum					
Kod	PMM503	Godina studija	2. godina diplomskog studija			
Nositelji predmeta	dr. sc. Antonela Matana	Bodovna vrijednost (ECTS)	5			
Suradnici		Način izvođenja nastave (broj sati u semestru)	P	S	V	T
			30		30	
Status predmeta		Postotak primjene e-učenja	20 %			
OPIS PREDMETA						
Ciljevi predmeta	Cilj predmeta je upoznati studente s osnovnim i izvedenim financijskim instrumentima te konceptima njihovog vrednovanja u okviru različitih modela financijskog tržišta. Studenti će steći vještine u korištenju i primjeni financijskih modela te provođenju analiza korištenjem financijskih programskih paketa.					
Uvjeti za upis predmeta i ulazne kompetencije potrebne za predmet	Nema uvjeta za upis.					
Očekivani ishodi učenja na razini predmeta (4-10 ishoda učenja)	<p>Po završetku kolegija, studenti će moći:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Razlikovati različite tipove financijskih instrumenata, njihovo značenje i interpretaciju u skladu s modelima financijskog tržišta. - Razlikovati modele financijskog tržišta u diskretnom i neprekidnom vremenu. - Analizirati modele financijskih tržišta uz razumijevanje njihovih prednosti i ograničenja u realnim situacijama. - Pravilno interpretirati podatke i provesti odgovarajuće analize u programskom okruženju. 					
Sadržaj predmeta detaljno razrađen prema satnici nastave	<ol style="list-style-type: none"> 1. Financijsko tržište. Osnovne pretpostavke u matematičkim modelima financijskih tržišta. Osnovni i izvedeni financijski instrumenti. 2. Model financijskog tržišta u diskretnom vremenu. Cox – Ross - Rubinsteinov ili binomni model. 3. Model financijskog tržišta u neprekidnom vremenu. 4. Izračunavanje cijena izvedenih financijskih instrumenata (Black - Scholesova formula). 5. Procjena volatilnosti. 6. CAP (<i>Capital Asset Pricing</i>) model. Modeliranje krivulje prinosa. Konstrukcija portfelja (b-koeficijenti, tržišni pokazatelji). 7. Mjere rizika na financijskom tržištu. Izračunavanje i procjena VaR (<i>Value at Risk</i>). 					
Vrste izvođenja nastave:	<input checked="" type="checkbox"/> predavanja <input type="checkbox"/> seminari i radionice <input checked="" type="checkbox"/> vježbe <input type="checkbox"/> <i>on line</i> u cijelosti <input type="checkbox"/> mješovito e-učenje <input type="checkbox"/> terenska nastava		<input type="checkbox"/> samostalni zadaci <input type="checkbox"/> multimedija <input type="checkbox"/> laboratorij <input type="checkbox"/> mentorski rad <input type="checkbox"/> (ostalo upisati)			
Obveze studenata	Pohađanje nastave, aktivno sudjelovanje u nastavnom procesu, kolokviji, ispiti.					
Praćenje rada studenata (<i>upisati udio u ECTS bodovima za svaku</i>)	Pohađanje nastave	1,0	Istraživanje		Praktični rad	
	Eksperimentalni rad		Referat		(Ostalo upisati)	

aktivnost tako da ukupni broj ECTS bodova odgovara bodovnoj vrijednosti predmeta):	Esej		Seminarski rad		(Ostalo upisati)	
	Kolokviji	4,0	Usmeni ispit		(Ostalo upisati)	
	Pismeni ispit		Projekt		(Ostalo upisati)	
Ocjenjivanje i vrjednovanje rada studenata tijekom nastave i na završnom ispitu	Pismeni ispit (100%). Studenti imaju mogućnost tokom semestra parcijalno polagati gradivo putem kolokvija. Održat će se dva kolokvija koja se sastoje od teorijskih i praktičnih zadataka. Studenti koji polože oba kolokvija oslobođeni su polaganja ispita.					
Obvezna literatura (dostupna u knjižnici i putem ostalih medija)	Naslov				Broj primjeraka u knjižnici	Dostupnost putem ostalih medija
	J. W. Campbell, A. W. Lo, A.C. MacKinlay, <i>The Econometrics of Financial Markets</i> , Princeton University Press, 1996.					
	J. C. Hull, <i>Options, Futures, and Other Derivative Securities</i> , 5 th edition, Prentice Hall, 2002.					
Dopunska literatura	1. W. A. Baxter, A. Rennie, <i>Financial Calculus</i> , Cambridge University Press, 1996. 2. P. Embrechts, C. Kluppelberg, and T. Mikosch, <i>Modelling Extremal Events for Insurance and Finance</i> , Springer Verlag, 1997. 3. <i>Financial Toolbox User's Guide</i> , The Mathworks, Inc, 2000.					
Načini praćenja kvalitete koji osiguravaju stjecanje utvrđenih ishoda učenja	Razgovor sa studentima, studentska evaluacija primjenom anonimne ankete, uspjeh studenata na ispitu, samoprocjena.					
Ostalo (prema mišljenju predlagatelja)	-					