

Elementi Finansijske matematike - Ispitna pitanja

Kamatne stope (diskretno obračunate, primeri)
Kamatne stope (neprekidno obračunate, primeri)
Kamatne stope (koje se neprekidno menjaju)
Kamatne stope (efektivna, nominalna, složena)
Sadašnja vrednost, intenzitet dobiti, teorema o ekvivalenciji dva toka novca)
Unutrašnja stopa dobiti, intenzitet dobiti
Ciklusi, inflacija
Vrednosni papiri sa fiksnim prihodom
Trajanje (duracija), konveksnost
Vrednosni papiri sa prihodom koji nije fiksiran
Modeliranje cena akcija, Wienerov proces, geometrijsko Brownovo kretanje
Binomni model, Geometrijsko Braunovo kretanje
Opcije i njihove osobine
Evropske opcije i nejednakosti koje zadovoljavaju, sa i bez dividendi
Američke opcije i nejednakosti koje zadovoljavaju, sa i bez dividendi
Evropske opcije (put-kol paritet)
Vrednost forward ugovora
Nalaženje cene opcije za binomni model sa jednim korakom
Formula Black-Scholes i njeno izvodjenje
Grčka slova i njihovo računanje
Obezbedjenje od rizika pomoću grčkih slova Δ i Γ
Vrednost pri riziku (VaR)
CAPM - model za određivanje cene akcija

Slobodanka Janković