

**Табела 5.2 Спецификација предмета**

Студијски програм/студијски програми : БАНКАРСТВО, ОСИГУРАЊЕ И БЕРЗЕ			
Врста и ниво студија: ОСНОВНЕ			
<b>Назив предмета: ПОРТФОЛИО МЕНАџМЕНТ</b>			
<b>Наставник (Име, средње слово, презиме): Проф. др Владимир М. Јовановић</b>			
Статус предмета: ИЗБОРНИ			
Број ЕСПБ: 7			
Услов:			
<b>Циљ предмета</b> Усвајање знања о особинама и употреби базичних и изведених финансијских инструмената и њихове употребе у финансијском управљању предузећа нефинансијског сектора; усвајање основних метода вредновања финансијских инструмената и портфолија; формулисање и примена инвестиционих стратегија			
<b>Исход предмета</b> Студент треба да стекне знања у области оптимизације трговачких портфолија хартија од вредности финансијских институција, мерења перформанси управљаних портфолија, дериватних инструмената хедџинга и метода који се користе у мерењу ризика трговачких (trading) и банкарских (banking book) портфолија.			
<b>Садржај предмета</b> Карактеристике индивидуалних хартија од вредности. Креирање портфолија. Основе Марковицеве теорије. Критични пут. Оптимални портфолио. Тржишни портфолио и тржишни индекси. Једноиндексни модели. Вишеиндексни модели. Претпоставке и теоријска анализа CAPM модела. Теорија арбитражног вредновања. Евалуација перформанси портфолија.			
<b>Литература</b> Дејан Шошкић "Хартије од вредности - Управљање портфолиом и инвестициони фондови", Економски факултет, Београд, 2013. Славомир Каличанин "Портфолио анализа инвестиционих фондова", ВШСС за рачуноводство и берзанско пословање, Београд, 2010.			
<b>Број часова активне наставе</b>			Остали часови
Предавања:	Вежбе:	Други облици наставе:	
3	1	/	/
<b>Методе извођења наставе</b> Предавања, интерактивни облици наставе, анализа случајева.			
<b>Оцена знања (максимални број поена 100)</b>			
<b>Предиспитне обавезе</b>	<b>поена</b>	<b>Завршни испит</b>	
активност у току предавања	<b>10</b>	писмени испит	
практична настава	<b>15</b>	усмени испт	
колоквијум-и	<b>20</b>	.....	
семинар-и			
Начин провере знања могу бити различити наведено у табели су само неке опције: (писмени испити, усмени испт, презентација пројекта, семинари итд.....			
Максимална дужна 1 страница А4 формата			
Спецификацију треба дати за сваки предмет из студијског програма. Ако постоје заједнички предмети за више студијских програма тада се у Књизи предмета, предмет приказује само један пут. Књига предмета представља јединствен прилог за све студијске програме првог и другог нивоа студија.			
Сваки предмет мора бити одвојени фајл, да би могао да се хиперлинком повеже са наставним особљем (Књига наставника) и планом студија Табела 5.1, односно 5.1а.			