

Šifra predmeta: QAN401	Naziv predmeta: STOHAŠTIČKI PROCESI		
Nivo: II ciklus studija	Godina: II	Semestar: III	Broj ECTS kredita: 6
Status: izborni			Ukupan broj sati: 30
1. CILJ PREDMETA	Cilj predmeta je da studenti ovladaju korisnim i praktičnim modelima i metodama stohastičkih procesa u sferi prvenstveno ekonomskog ali također i društvenog stanovišta, kako stohastički procesi proizvode reperkusije u praktičnim ostvarenjima poslovnih procesa.		
1.1. Osnovne tematske jedinice	1. Stohastički procesi i principi modeliranja 2. Principi i klasifikacija stohastičkih procesa 3. Markovljevi lanci i procesi 4. Monte-Carlo proces i model 5. Vremenske serije 6. Brownovo kretanje 7. Gauss-Wiener procesi 8. Simultani modeli i metode stohastičkih procesa 9. Stohastički procesi u životnim osiguranjima 10. Stohastički procesi u neživotnim osiguranjima		
1.2. Rezultati učenja	Nakon položenog ispita, studenti će biti osposobljeni da koriste različite modele i metode stoastičkih procesa u ekonomskoj analizi, u proiciranju, prognoziranju i planiranju budućih događaja relevantnih za društvene i poslovne procese.		
2. NAČIN ORGANIZACIJE NASTAVE			
	Opis aktivnosti (%)		
2.1. Način izvođenja nastave	1. ex katedra 2. prezentacije 3. gosti predavači 4. vježbe 5. diskusije	1. 50 % 2. 10 % 3. 10 % 4. 20 % 5. 10 %	
	Učešće u ocjeni (%)		
2.2. Sistem ocjenjivanja	1. parcijalni 2. seminarski rad 3. projekat 4. prezentacija 5. finalni ispit 6. usmeni razgovor	1. 30 % 2. 5 % 3. 10 % 4. 5 % 5. 40 % 6. 10 %	
3. LITERATURA	1. Benjamin, B. And Pollard, J. H.: The Analyses of Mortality and Other Actuarial Statistics, Institute and Faculty of Actuaries, London, 1997. 2. Kovačić, Z.: Analiza vremenskih serija, Ekonomski fakultet, Beograd, 1998. 3. Lučić, B.: Statistika, Ekonomski fakultet, Sarajevo, 1998. 4. Papouls, A.: Probability, Random Variables and Stochastic Processes, McGraw Hill, Boston, 2001. 5. Ross, S.: Stochastic Processes, J. Wiley, New York, 1996.		