Predispitni poeni iz predmeta investiranje u hartije od vrednosti ostvaruju se izradom seminarskog rada umesto kolokvijuma.

Seminarski rad mogu raditi studenti u grupama od po jednog do tri kandidata. Studenti koji žele da rade seminarski rad, potrebno je da se prijave putem mejla na adresu jovan.nj@gmail.com, i da u prijavi navedu ime, prezime i broj indeksa svih studenata u grupi. Nakon toga, dobiće mejlom odgovor sa navedenim hartijama od vrednosti za koje treba da urade analize. Kada seminarski rad završe, šalju ga ponovo putem mejla kao reply na prethodnu poruku.

**Seminarski radovi će biti prihvatani najkasnije do 7 dana pred polaganje ispita.**

Rad obuhvata istraživanje kretanja portfolija hartija od vrednosti u periodu COVID-19 krize u odnosu na kretanja u 2019. godini. Rad podrazumeva:

* Kreiranje optimalnih Sharpe i GMV portfolija za 2019. godinu (prema video predavanjima)
	+ Portfolije priložiti u xlsx dokumentu, u sheet-u pod nazivom **2019**
	+ u docx dokumentu prikazati analizu portfolija. Obavezni elementi analize su:
		- poređenje uspešnosti i rizičnosti pojedinačnih akcija u portfoliju,
		- prikaz ostvarenih udela, prinosa, standardne devijacije i Sharpe racija za GMV i Sharpe optimalni portfolio
		- prikaz grafika sa linijom granične efikasnosti, unetim pojedinačnim akcijama, i optimalnim GMV i Sharpe portfolijima
* Kreiranje optimalnih Sharpe i GMV portfolija za period od 01.01.2020 do 01.05.2020
	+ Portfolije priložiti u xlsx dokumentu, u sheet-u pod nazivom **2020**
	+ u docx dokumentu prikazati analizu portfolija. Obavezni elementi analize u docx dokumentu su isti kao i za 2019 godinu
* Poređenje perioda COVID krize sa 2019 godinom
	+ u docx dokumentu prikazati poređenje portfolija iz perioda COVID krize i 2019. godine
		- Da li su se i u kojoj meri promenila kretanja pojedinačnih akcija?
		- Šta se desilo sa strukturom portfolija – da li su se i u kojoj meri promenili udeli?
		- Izračunati i uporediti – ukoliko bismo koristili udele iz GMV portfolija za 2019. godinu za period COVID krize, kakvi bi bili prinosi, rizik i Sharpe racio u odnosu na GMV portfolio za 2020. godinu?

**Primer sa najvažnijim (ne svim potrebnim!) elementima analize možete pronaći na sajtu u excel tabeli**