

ИЗВЕШТАЈ О ОЦЕНИ МАСТЕР РАДА

I ПОДАЦИ О КОМИСИЈИ
<ol style="list-style-type: none">1. Датум и орган који је именовео Комисију Веће Департмана за математику и информатику Природно-математичког факултета Универзитета у Новом Саду2. Састав Комисије са знаком имена и презимена сваког члана, звања, назива уже научне области за коју је изабран у звање, датума избора у звање и назив факултета, установе у којој је члан комисије запослен:<ol style="list-style-type: none">1. др Наташа Крејић, редовни професор Природно-математичког факултета у Новом Саду – председник комисије2. др Милош Божовић, доцент Економског факултета у Београду – ментор3. др Наташа Спахић, ванредни професор Природно-математичког факултета у Новом Саду – члан
II ПОДАЦИ О КАНДИДАТУ
<ol style="list-style-type: none">1. Име, име једног родитеља, презиме: Бојана, Драган, Мићић2. Датум рођења, општина, република: 27.04.1991, Зрењанин, Србија3. Година уписа на дипломске академске студије, смер/усмерење: 2013, Дипломске академске-мастер, примањена математика
III НАСЛОВ МАСТЕР РАДА
„Моделирање оперативног ризика применом копула“
V ПРЕГЛЕД МАСТЕР РАДА
<p>Рад је написан на 67 страна и чине га 5 поглавља, 18 табела, 30 графика и 28 референци коришћених у раду.</p> <p>Циљ рада је да се истражи у којој мери примена модела заснованог на расподели губитака утиче на смањење капиталних захтева за оперативне ризике. Поред тога анализира се утицај моделирања зависних структура применом копула на обрачун капиталних захтева.</p> <p>Поглавља садржана у раду: 1. Увод; 2. Ризици у банкарству; 3. Напредни приступ мерења оперативног ризика- приступ заснован на расподели губитака; 4. Моделирање зависних структура; 5. Подаци.</p>
IV ВРЕДНОВАЊЕ ПОЈЕДИНИХ ДЕЛОВА МАСТЕР РАДА
<p>Прво поглавље уводи читаоца у проблематику рада и садржи преглед основних теорема и дефиниција потребних за разумевање изложене теорије.</p> <p>Друго поглавље садржи приказ управљања оперативним ризицима, основне принципе Базелског комитета и кратак опис техника које се користе за мерење изложености оперативним ризику.</p>

Трећи део описује напредни приступ мерења оперативног ризика заснованог на расподели губитака. У овом делу је описана методологија која се користи за моделирање обрачуна капиталних захтева.

Четврти део представља анализу зависних структура различитих типова догађаја оперативног ризика и пружа вишедимензионалну анализу оперативног ризика.

Пето поглавље садржи емпиријске резултате до којих се дошло помоћу методологије описане у претходним поглављима и закључак у ком су сумирани осовни резултати рада. За емпиријски део рада коришћени су софтверски пакети Matlab и Statistica.

VI ЗАКЉУЧЦИ ОДНОСНО РЕЗУЛТАТИ ИСТРАЖИВАЊА

Резултат истраживања у овом раду је математички модел обрачуна капиталних захтева за оперативне ризике. Модел даје процену за минималне капиталне захтеве добијене анализирањем зависних структура различитих типова догађаја оперативног ризика. Алгоритам за решавање проблема је развијен у програмском пакету Matlab и примењен је на историјске податке. Добијени резултати показују предност коришћења напредних модела и анализирања зависних структура у обрачуна капиталних захтева у односу на стандардизовани приступ управљању оперативним ризиком.

VII КОНАЧНА ОЦЕНА МАСТЕР РАДА

Мастер рад је у потпуности урађен у складу са одобреном темом. Сви проблеми наведени у пријави су детаљно анализирани и приказани. Рад је прегледно и добро написан са резултатима добијеним кроз реалну примену.

VIII ПРЕДЛОГ

Имајући у виду све претходно речено, Комисија предлаже да се мастер рад прихвати, а кандидаткињи Бојани Мићић одобри одбрана.

Нови Сад, 13.10.2016.

ПОТПИСИ ЧЛАНОВА КОМИСИЈЕ
