

Crna Gora
UNIVERZITET CRNE GORE
PRIRODNO-MATEMATIČKI FAKULTET

Primljeno:	16 03 2018		
Org. jed.	Kroj	Prilog	Vrijednost
	070		

MOLBA

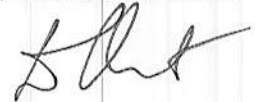
Vijeću PMF-a

Molim vas da u program magistarskih studija na studijskom programu Matematika i računarke nauke ubrstite predmet: *Procjena rizika u bankarskim sistemima*. Predmet će dodatno obogatiti listu izbornih predmeta na magistarskim studijama i konkretizovaće obrazovanje studenata zainteresovanih za primjenu finansijske matematike u bankama koje čine glavninu finansijskih institucija u Crnoj Gori.

U prilogu je ECTS catalog za predmet.

Unaprijed hvala,

Prof.dr Darko Mitrović



Naziv predmeta: Procjena rizika u bankarskim sistemima				
Šifra predmeta	Status predmeta	Semestar	Broj ECTS kredita	Fond časova
(vidi napomenu)	izborni	I	4	2P

Crna Gora
UNIVERZITET CRNE GORE
PRIRODNO-MATEMATIČKI FAKULTET
Primljeno: 16. 03. 2018
Org. jed. 6701/03
Vrijednost 2018

Studijski programi za koje se organizuje: magistarske studije na Prirodno-matematičkom fakultetu, modul Matematika i računarske nauke

Uslovljenost drugim predmetima: nema

Ciljevi izučavanja predmeta: Upoznavanje s matematičkim metodama neophodnim za modeliranje procjena rizika u bankarskim sistemima prije svega vezanih za dodjelu kredita.

Ime i prezime nastavnika i saradnika:

Darko Mitrović

Metod nastave i savladavanja gradiva: Predavanja. Izrada seminarskih radova

Sadržaj predmeta: (Nazivi metodskih jedinica, kontrolnih testova, kolokvijuma i završnog ispita po nedjeljama u toku semestra)

Pripreme nedjelje	Priprema i upis semestra
I nedjelja	Uvod u rizike kod poslovanja banaka
II nedjelja	Mrežni model inter-bankarskog tržišta
III nedjelja	Vrste podataka u bankama (podaci o poslovanju, kreditnoj izloženosti i tržištu)
IV nedjelja	Procjena interbankarske pouzdanosti iz parcijalnih informacija
V nedjelja	Stvaranje mogućih scenarija. Rizici na tržištu i »istorijska simulacija«
VI nedjelja	Kreditni rizici: izračunavanje distribucije gubitka kod pozajmica
VII nedjelja	Kombinovanje tržišnih rizika, kreditnih rizika i mrežnog modela
VIII nedjelja	Rezultati modela: simulacija kratkoročnih i dugoročnih scenarija
IX nedjelja	Procjena povrata u slučaju bankrota nosioca kredita
X nedjelja	Sistematska stabilnost: Fundamentalna protiv ugroženih sredstava
XI nedjelja	Procjena troškova krizne intervencije
XII nedjelja	Veza između bankota i ugroženih kredita
XIII nedjelja	Uloga umrežene bankarske strukture
XIV nedjelja	Odbrana seminarskog, I dio
XV nedjelja	Odbrana seminarskog, II dio
XVI nedjelja	Završni ispit
Završna nedjelja	Ovjera semestra i upis ocjena
XVIII-XXI nedjelja	Dopunska nastava i poravni ispitni rok

OPTEREĆENJE STUDENATA

nedjeljno	u semestru
Broj sati: 4 x 40/30=5h20min	Nastava i završni ispit: 5h20min x 16=85h20min
Predavanja: 2h	Neophodne pripreme (administracija, upis, ovjera prije početka semestra): 5h20min x 2=10h40min
Individualni rad studenata: 3h20min	Ukupno opterećenje za predmet: 4 x 30=120h
	Dopunski rad: 24h
	Struktura opterećenja: 68h20min (nastava)+10h40min (admin.priprema)+24h (dopunski rad)

Naveći obaveze studenata u toku nastave

Literatura: 1. H.Elsinger, A.Lehar, M.Summer, *Risk Assesment for Banking Systems*, Management science (2006), 1301-1314. 2. P.Jorion, *Value-at-Risk*, (McGraw-Hill) second edn.

Oblici provjere znanja i ocjenjivanje: Seminarski rad 50 bodova. Završni ispit 50 bodova.

Posebnu naznaku za predmet: Dodatne informacije se mogu naći kod nastavnika.

Ime i prezime nastavnika koji je pripremio podatke: Darko Mitrović

Napomena: Dodatne informacije o predmetu