

Ekonomski fakultet / POSLOVNA EKONOMIJA / UPRAVLJANJE RIZICIMA

Uslovljenost drugim predmetima	Predmet nije uslovljen drugim predmetima.
Ciljevi izučavanja predmeta	Izučava se problematika rizika. Uvode se mjere rizika, u prvom redu VaR mjera. Akcenat je na tržišnom, kreditnom i operativnom riziku.
Ime i prezime nastavnika i saradnika	Prof. dr Vladimir Kaščelan, Prof dr Milijana Novović Burić saradnik: mr Milan Raičević
Metod nastave i savladanja gradiva	
I nedjelja, pred.	Definisanje rizika i vrste rizika. Faze upravljanje rizikom. Integrisano upravljanje rizicima (ERM).
I nedjelja, vježbe	Prate predavanja (i dalje)
II nedjelja, pred.	Finansijsko tržište, finansijske institucije i tehnike upravljanja rizicima.
II nedjelja, vježbe	
III nedjelja, pred.	Rizik vs prinos. Hedžing. Volatilnost. Korelacija
III nedjelja, vježbe	
IV nedjelja, pred.	Mjere rizika. VaR mjera
IV nedjelja, vježbe	
V nedjelja, pred.	Osiguranje i reosiguranje kao tradicionalni metod transfera rizika
V nedjelja, vježbe	
VI nedjelja, pred.	Osiguranje i reosiguranje kao tradicionalni metod transfera rizika- nastavak. Kreditni rizik
VI nedjelja, vježbe	
VII nedjelja, pred.	Prvi kolokvijum . Praksa
VII nedjelja, vježbe	
VIII nedjelja, pred.	Aktuarski rizici
VIII nedjelja, vježbe	
IX nedjelja, pred.	Kreditni rizik. Rizik likvidnosti
IX nedjelja, vježbe	
X nedjelja, pred.	Rizik kamatne stope. Operativni rizik. Ostali rizici
X nedjelja, vježbe	
XI nedjelja, pred.	Upravljanje rizicima putem derivata
XI nedjelja, vježbe	
XII nedjelja, pred.	Sekjuritizacija kredita i finansijska kriza
XII nedjelja, vježbe	
XIII nedjelja, pred.	Kapitalni zahtjevi za rizike: Solvency II i Basel II
XIII nedjelja, vježbe	
XIV nedjelja, pred.	Drugi kolokvijum. Praksa
XIV nedjelja, vježbe	
XV nedjelja, pred.	Popravni kolokvijumi
XV nedjelja, vježbe	
Obaveze studenta u toku nastave	
Konsultacije	
Opterećenje studenta u casovima	
Literatura	John C.Hull: Risk management and Financial institutions, Pearson, Prentice Hall, 5th ed. 2018. Ćurak M, Jakovčević D.: Osiguranje i rizici, Rif Plus, Zagreb, 2007.
Oblici provjere znanja i	Kvizovi- 15 poena, 2 kolokvijuma po 25 poena i završni ispit 35 poena

ocjenjivanje	
Posebne naznake za predmet	
Napomena	
Ishodi učenja	Po završetku ovog kursa student će moći da: 1. Analizira rizike i definiše metode upravljanja rizikom sa aspekta svakog preduzeća 2. Objasni rizike sa kojima se suočavaju finansijske institucije 3. Analizira tradicionalne i alternativne metode transfera rizika 4. Procjenjuje veličinu finansijskih i aktuarskih rizika 5. Objasni metode za upravljanje pojedinim finansijskim i aktuarskim rizicima koristeći mjere rizika prezentirane u okviru kursa.