

Ekonomski fakultet / Menadžment Podgorica (model studija 3+2) / UPRAVLJANJE

FINANSIJSKIM 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 i kreditnom 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. 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 ocjenjivanje	Kvizovi - 5 poena, SeminarSKI rad - 10 poena, Dva kolokvijuma po 25 poena, Završni ispit - 35 poena
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 rizika 4. Objasni metode za upravljanje pojedinim finansijskim rizicima analizirajući specifičnosti crnogorskog tržišta