|  |
| --- |
| **ВИСОКА ПОСЛОВНА ШКОЛА СТРУКОВНИХ СТУДИЈА НОВИ САД** |
| **Школска година и семестар** | 2019/20ЗИМСКИ |
| **Студијски програм**  | МЕЂУНАРОДНО ПОСЛОВАЊЕ И ФИНАНСИЈЕ |
| **Назив предмета** | **УПРАВЉАЊЕ ФИНАНСИЈСКИМ РИЗИЦИМА** |
| **Наставник** | др Жељко Рачић |
| **Aсистент** | Дајана Ерцеговац |
| **Статус предмета** | Обавезни |
| **Број ЕСПБ** | 7 |
|  |  |
| **Циљ предмета:** Циљ предмета је стицање специфичних функционалних знања и вештина карактеристичних за управљање финансијским ризицима, као и развијање способности студената да стечена знања и вештине примене у пракси. Циљ је да по завршетку процеса учења студенти знају да идентификују и опишу најзначајније врсте финансијских ризика са којима се сусрећу предузећа и финансијске институције, да анализирају њихов утицај на пословање и да опишу основне и напредне методе које се користе за њихово мерењe и управљањe. Циљ је да студенти након завршетка процеса учења у оквиру предмета науче да примене напредне моделе мерења и управљања кредитним, тржишними оперативним ризицима, као и да знају да опишу карактеристике финансијских деривата и поступке њихове примене у процесу управљања финансијским ризицима. |
| **Исход предмета:** По завршетку процеса учења у оквиру предмета Управљање финансијским ризицима, студенти ће бити у стању да:* дефинишу основне врсте финансијских ризика којима су изложена предузећа и финансијске институције,
* процењују тенденције развоја финансијских деривата и утицај њихове примене на процесе управљања финансијским ризицима,
* идентификују финансијске ризике карактеристичне за међународно финансијско пословање (девизни ризик, ризик каматне стопе, итд.) и анализирају њихове основне елементе,
* објасне основне методе мерења финансијских ризика и упореде њихове карактеристике,

примене основне методе управљања финансијским ризицима. |
| **Садржај предмета:** *Теоријска настава:** Управљање ризиком у финансијском пословању
* Управљање тржишним ризиком
* Управљање кредитним ризиком
* Управљање каматним ризиком, валутним ризиком и ризиком ликвидности
* Управљање оперативним ризиком

*Практична настава:** Анализе студија случаја.
* Израда семинарских радова уз примену релевантних метода истраживачког рада. Презентовање семинарских радова у циљу синтезе стечених знања.
 |
| **ПЛАН И ПРОГРАМ РАДА** |
| **Недеља** | **Наставна јединица** |
| **1.** | Основне информације о предмету; Управљање ризиком у финансијском пословању: дефиниција ризика, нужност управљања ризиком и основни ризици у финансијском пословању; |
| **2.** | Избор тема за семинарски рад и прецизирање датума одбране рада;Активност студената – понављање претходног градива; |
| **3.** | Процес управљања ризиком у финансијском пословању;Активност студената – понављање претходног градива; |
| **4.** | Управљање тржишним ризиком, метода ризичне вредности ВАР;Активност студената – понављање претходног градива; |
| **5.** | Управљање тржишним ризиком, мерење волатилности и корелираности, Базелски споразуми.Активност студената и презентација семинарских радова. |
| **6.** | Понављање градива и припрема за колоквијум;Активност студената и презентација семинарских радова. |
| **7.** | Колоквијум |
| **8.** | Управљање кредитним ризиком;Презентација семинарских радова. |
| **9.** | Управљање кредитним ризиком, квантитативна анализа клијента, рацио анализа;Активност студената и презентација семинарских радова. |
| **10.** | Управљање каматним и валутним ризиком;Активност студената и презентација семинарских радова. |
| **11.** | Заштита од ризика употребом форварда, фјучерса, свопова, опција и депозита индексираних у валути;Управљање ризиком ликвидности;Активност студената и презентација семинарских радова. |
| **12.** | Управљање оперативним ризиком; Консултације у вези испита.Активност студената и презентација семинарских радова. |
| **13.** |  |
| **14.** |  |
| **15.** |  |
| **Литература** Лидија Барјактаровић, Управљање ризиком, Сингидунум, Београд, 2013. |
| **Број часова активне наставе** | **Теоријска настава: 45** | **Практична настава: 45**  |
| **Оцена знања (максимални број поена 100)** |
| **Предиспитне обавезе** | **55** | **Завршни испит**  | **45** |
| присуство на предавањима и вежбама | **5** | писмени испит |  |
| провера знања у току наставе (колоквијум-и) | **30** | усмени испит |  |
| остале активностии учешће студената у раду на предавањима и вежбама  | **10** |  |  |
| практичан рад: студија случаја | **10** |  |  |