|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **ВИСОКА ПОСЛОВНА ШКОЛА СТРУКОВНИХ СТУДИЈА НОВИ САД** | | | | | | | |
| **Школска година и семестар** | | 2019/20  ЗИМСКИ | | | | | |
| **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** | |  |  |