**Табела 5.2.** Спецификација предмета

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Студијски програм:** Напредна аналитика података у пословању | | | | |
| **Назив предмета: Управљање ризиком** | | | | |
| **Наставник/наставници:** дрЈелена З. Станковић | | | | |
| **Статус предмета:** изборни предмет | | | | |
| **Број ЕСПБ: 7** | | | | |
| **Услов:** основно познавање финансија и економије | | | | |
| **Циљ предмета**  Циљ изучавања овог предмета је стицање неопходних теоријских знања за доношење одлука везаних за управљање финансијским ризицима ентитета у савременим условима пословања. На основу познавања и разумевања проблема везаних за идентификацију ризика, специфичности њиховог испољавања у различитим ентитетима, затим процене вероватноће и економских последица њиховог настанка како за ентитет тако и за систем у целини, студенти ће бити оспособљени да донесу одлуку о избору адекватне стратегије управљања конкретним ризиком. Понуђена нова знања ће студентима омогућити разумевање и спровођење националних и наднационалних регулаторних захтева у погледу управљања ризицима финансијских и нефинансијских институција. | | | | |
| **Исход предмета**  Студенти ће бити у могућности да:   * идентификују потенцијалне финансијске и специфичне ризике ентитета; * изврше њихово квантификовање и оцене ефекте њиховог дејства; * одаберу адекватну стратегију за управљањем ризиком; * управљају ризицима на начин који доприноси стварању вредности ентитета. | | | | |
| **Садржај предмета**  *Теоријска настава*  Концепт ризика на глобализованом финансијском тржишту; Врсте и карактеристике финансијских ризика; Специфични ризици осигуравајућих компанија; Екстремни ризици у финансијама и осигурању; Традиционални и савремени приступи вредновању ризика; Стратегије управљања ризицима; Регулаторни оквири за управљање ризицима  *Практична настава*  Анализа финансијских токова и идентификовање ризика (студија случаја); анализа ефеката примене различитих модела за вредновање ризика (студија случаја); избор стратегије за управљање ризицима (анализа студије случаја); дискусија о ефектима примене регулаторних захтева у управљању ризицима (предавање експерата по позиву) | | | | |
| **Литература**   1. Sweeting, P. (2017) Financial Enterprise Risk Management, Cambridge University Press 2. Hull, J. C. (2018) Risk Management and Financial Institutions, 5th Edition. John Wiley & Sons Ltd. 3. Holton, G. A. (2014) Value-at-Risk – Theory and Practice, 2nd Edition. Published by the author. 4. Miller, M. (2018) Quantitative Risk Management, John Wiley & Sons Ltd.. | | | | |
| **Број часова активне наставе** | **Теоријска настава:** 30 | | **Практична настава:** 45 | |
| **Методе извођења наставе**  Излагање наставника, студије случаја, дискусија и анализа актуелних кретања на финансијском тржишту, примена софтверских пакета за вредновање ризика, гостујућа предавања експерата. | | | | |
| **Оцена знања (максимални број поена 100)** | | | | |
| **Предиспитне обавезе** | Поена | **Завршни испит** | | поена |
| активност у току предавања | 10 | писмени испит | | 0 |
| практична настава | 10 | усмени испт | | 50 |
| колоквијум-и | 20 | Презентација пројекта | | 0 |
| семинар-и | 10 | **Укупно** | | **100** |