

SYLLABUS

1. Puni naziv nastavnog predmeta:

Analiza i upravljanje finansijskim rizicima

2. Skraćeni naziv nastavnog predmeta / šifra:

ne popunjavati

3. Ciklus studija:

1

4. Bodovna vrijednost ECTS:

7

5. Status nastavnog predmeta: Obavezni Izborni**6. Preduslovi za polaganje nastavnog predmeta:****7. Ograničenja pristupa:****8. Trajanje / semestar:**

15

7

9. Sedmični broj kontakt sati:

9.1. Predavanja:

4

9.2. Auditorne vježbe:

2

9.3. Laboratorijske / praktične vježbe:

0

10. Fakultet:

Ekonomski fakultet

11. Odsjek / Studijski program:

Ekonomija/I ciklus

12. Odgovorni nastavnik:

Dr. sc. Emira Kozarević, redovni profesor

13. E-mail nastavnika:

emira.kozarevic@untz.ba

14. Web stranica:

ef.untz.ba

15. Ciljevi nastavnog predmeta:

Steći bazična znanja o rizicima kojima su u svom poslovanju izložene danas dominantne vrste finansijskih institucija (evoluciji, taksonomiji, strategijama ublažavanja, motivima i procesu aktivnog upravljanja te regulaciji i superviziji istih).

16. Ishodi učenja:

Nakon uspješnog okončavanja ovog modula, studenti će biti sposobni da:

- Diferenciraju širok spektrom različitih rizika kojima su u svom poslovanju izložene danas dominantne vrste finansijskih institucija;
- Razumiju raspoložive strategije upravljanja finansijskim rizicima i, što je još važnije, motive i sam proces tzv. aktivnog upravljanja finansijskim rizicima;
- Upoznaju se sa aktuelnim (pozitivnim) propisima iz domena nacionalnih i internacionalne supervizije upravljanja finansijskim rizicima.

17. Indikativni sadržaj nastavnog predmeta:

1. Uvod u selektivnu historiju finansijskih rizika
2. Taksonomija finansijskih institucija (aktivno upravljane vs. pasivno upravljane), finansijskih usluga i finansijskih rizika
3. Motivi upravljanja finansijskim rizicima
4. Proces upravljanja finansijskim rizicima
5. Procedure i principi za implementaciju upravljanja rizicima na nivou finansijske institucije
6. Analiza i upravljanje rizicima banaka, osiguravajućih društava i investicionih (uzajamnih) fondova
7. Prudenciona supervizija finansijskih rizika (OECD, EU i tranzicijske zemlje)
8. Hedžing operacije

18. Metode učenja:

- Predavanja se organizuju po strukturi: ex katedra (60%), analiza slučaja iz prakse (20%) i diskusije (20%). Predavanja se izvode po nastavnom programu opisanom u sadržaju kursa.
- Vježbe su fokusirane na analizu slučaja iz prakse i praćenje napredovanja studenata.
- Konsultacije su organizovane u dva termina sedmično.

19. Objašnjenje o provjeri znanja:

Za svaki od predviđenih metoda provjere znanja student dobiva određen broj bodova i ukupna ocjena se izvodi kao kumulativ ostvarenih bodova po različitim aktivnostima studenata. Ocjena se formira spram odredbe Zakona o visokom obrazovanju TK, član 107.

PREDISPITNE OBAVEZE

- (1) Uspješno završen i prezentiran individualni seminarski rad donosi maksimalno 10 bodova, domaća zadaća maksimalno 5 bodova i kviz 5 bodova.
- (2) Testovi se rade u prethodno dogovorenim terminima i boduju se prema tačnosti odgovora na postavljena pitanja/zadatke.
- (3) Prvi test obuhvata teoriju iz oblasti Uvod u selektivnu historiju finansijskih rizika.
- (4) Drugi test obuhvata teoriju iz oblasti: Taksonomija finansijskih institucija (aktivno upravljane vs. pasivno upravljane), finansijskih usluga i finansijskih rizika, Mjesto upravljanja rizicima u finansijskim institucijama i evaluacija, kao sine qua non upravljanja rizicima.
- (5) Treći test obuhvata teoriju iz oblasti: Upravljanje rizicima banaka.

ZAVRŠNI ISPIT

- (6) Završni ispit (test ili/usmeni) predstavlja konačnu provjeru znanja studenta. Završni ispit obuhvata teoriju iz oblasti: Upravljanje rizicima osiguravajućih društava i Upravljanje rizicima investicionih/uzajamnih fondova.

20. Težinski faktor provjere:**PREDISPITNE OBAVEZE – 70**

Tri testa (I:15; II:15; III:15 = 45)

Individualni seminarski rad (10)

Domaća zadaća (5)

Kviz (5)

Analiza slučaja iz prakse - individualni ili grupni rad (5)

ZAVRŠNI ISPIT – 30

Završni test (test i/ili usmeni ispit) (30)

Ocjena se formira spram odredbe Zakona o visokom obrazovanju TK, član 107.

21. Osnovna literatura:

1. Kozarević E., Analiza i upravljanje finansijskim rizicima, CPA, Tuzla, 2009.
2. Saunders A., Cornett M. M., Financial institutions management – a risk management approach, McGraw-Hill/Irwin, New York, 2006.

22. Internet web reference:

- Internet stranice BIS-a, BCBS-a, profesionalnih udruženja risk analitičara i dr.

23. U primjeni od akademske godine:

2023/2024

24. Usvojen na sjednici NNV/UNV:

26.09.2023.