

## SYLLABUS

**1. Puni naziv nastavnog predmeta:**

Portfolio menadžment finansijskih institucija

**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:**

Nema

**7. Ograničenja pristupa:****8. Trajanje / semestar:**

1

8

**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

**12. Odgovorni nastavnik:**

Dr. sc. Meldina Kokorović Jukan, vanredni profesor

**13. E-mail nastavnika:**

meldina.kokorovic@untz.ba

**14. Web stranica:**

www.ef.untz.ba

**15. Ciljevi nastavnog predmeta:**

Steći bazična znanja o poslovanju temeljnih tipova finansijskih institucija kao (finansijskih) firmi/preduzeća. Poseban akcentat biti će stavljen na pitanja analize finansijskih izvještaja tih firmi i njihovo upravljanje aktivom i obavezama. Takođe, detaljno će biti elaborirana regulativa finansijskih institucija u našoj i zemljama sa razvijenim finansijskim sistemima u segmentu njihovog portfolio menadžmenta.

**16. Ishodi učenja:**

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

- Analiziraju, preispituju i uspoređuju funkcionisanje različiti finansijskih institucija kao (finansijskih) preduzeća/firmi
- Analiziraju finansijske izvještaje finansijskih institucija u razvijenim zemljama i BiH
- Identificiraju specifičnosti regulatornog okvira poslovanja finansijskih institucija (posebno u segmentu njihovog portfolio menadžmenta) u razvijenim zemljama i BiH
- Analiziraju savremena kretanja u poslovanju finansijskih institucija i aktivnosti na globalnom finansijskom tržištu

**17. Indikativni sadržaj nastavnog predmeta:**

1. Pojam i kreiranje portfolija
2. Portfolio rizik
3. Evolutivni put portfolio menadžmenta
4. Uloga moderne portfolio teorije (MPT) u razvoju portfolio menadžmenta
5. Taksonomija finansijskih institucija – bankarske vs. nebankarske finansijske institucije
6. Upravljanje aktivom i obavezama banaka
7. Upravljanje aktivom i obavezama nebankarskih finansijskih institucija
8. Ocjena efikasnosti portfolija finansijskih institucija
9. Zakonska ograničenja portfolio menadžmenta finansijskih institucija (OECD, EU i BiH)

**18. Metode učenja:**

Predavanja će biti organizovana po strukturi: ex katedra (60%), analiza slučajeva iz prakse (20%) i diskusije (20%). Vježbe su fokusirane na analizu slučajeva iz prakse i praćenje napredovanja studenata. Obaveza studenata je prisustvo na predavanjima i vježbama. Dozvoljena su maksimalno tri izostanaka sa predavanja i vježbi, ukupno.

**19. Objašnjenje o provjeri znanja:****PREDISBITNE OBAVEZE**

U toku semestra student je u obavezi uraditi seminarski rad i studiju slučaja na zadanu temu. Predmetni nastavnik utvrđuje listu tema za seminarske radove i studije slučaja na početku semestra. Seminarski rad je samostalni rad studenta.

Testovi se rade u prethodno dogovorenim terminima i boduju se prema tačnosti odgovora na postavljena pitanja/zadatke.

Prvi test obuhvata teoriju iz oblasti: Uvod u portfolio menadžment, Portfolio menadžment (komercijalnih) banaka, Portfolio menadžment centralnih banaka i Portfolio menadžment ostalih depozitnih institucija

Drugi test obuhvata teoriju iz oblasti: Portfolio menadžment ugovorno-štednih institucija - penzionih fondova i osiguravajućih društava, Portfolio investicionih banaka i brokersko dilerskih društava

Treći test obuhvata teoriju iz oblasti: Portfolio menadžment investicionih fondova, hedž fondova i fondova rizičnog kapitala

Četvrti test obuhvata teoriju iz oblasti: Portfolio menadžment mikrokreditnih institucija, Portfolio menadžment razvojnih banaka Portfolio menadžment ostalih tipova finansijskih institucija..

**ZAVRŠNI ISPIT**

Završni ispit (test i/ili usmeni) predstavlja konačnu provjeru znanja studenta i obuhvata odabrane teme iz nastavnog predmeta.

**20. Težinski faktor provjere:****PREDISBITNE OBAVEZE – 80**

Četiri testa koji obuhvataju teoriju i zadatke ( $4 \times 10 = 40$ )

Seminarski rad (30)

Studija slučaja (10)

**ZAVRŠNI ISPIT – 20**

Završni test koji obuhvata teoriju (eventualno i usmeni ispit) (20)

Konačna ocjena se formira u skladu sa bodovnom skalom propisanom članom 107. Zakona o visokom obrazovanju Tuzlanskog kantona (Službene novine TK, br.21-2021- prečišćeni tekst).

**21. Osnovna literatura:**

1. Kozarević E., Kokorović Jukan, M., Softić, A., Finansijske institucije - pristup portfolio menadžmenta, PrintCom, 2017.

**22. Internet web reference:**

- Internet stranice raznih domaćih i stranih finansijskih institucija (nacionalnih i supranacionalnih)

**23. U primjeni od akademske godine:**

2023/2024

**24. Usvojen na sjednici NNV/UNV:**

26.09.2023.