

## 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:**

15

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/I

**12. Odgovorni nastavnik:**

Dr. sc. Emira Kozarević, redovni profesor

**13. E-mail nastavnika:**

emira.kozarevic@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:**

- Pojam i kreiranje portfolija
- Portfolio rizik
- Evolutivni put portfolio menadžmenta
- Uloga moderne portfolio teorije (MPT) u razvoju portfolio menadžmenta
- Taksonomija finansijskih institucija – bankarske vs. nebankarske finansijske institucije
- Upravljanje aktivom i obavezama banaka
- Upravljanje aktivom i obavezama nebankarskih finansijskih institucija
- Ocjena efikasnosti portfolija finansijskih institucija
- 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. Konsultacije su organizovane u dva termina sedmično i to je fakultativna ponuda studentima.

**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 i to ocjena 6 (54-64); ocjena 7 (65-74); ocjena 8 (75-84); ocjena 9 (85-94) i ocjena 10 (95-100).

**PREDISPITNE OBAVEZE**

- (1) Student koji je izvršio sve obaveze vezane za seminarski rad (uradio rad u skladu sa dogovorenim metodologijom i prezentirao isti) dobiva maksimalno 30 bodova, a za domaću zadaću maksimalno 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 portfolio menadžment, Portfolio menadžment (komercijalnih) banaka, Portfolio menadžment centralnih banaka i Proftolio menadžment ostalih depozitnih institucija
- (4) Drugi test obuhvata teoriju iz oblasti: Portfolio menadžment ugovorno-štednih institucija - penzionih fondova i osiguravajućih društava, Portofolio mendažment mikrokreditnih institucija, Porftolio mendažment razvojnih banaka
- (5) Treći test obuhvata teoriju iz oblasti: Portfolio menadžment investicionih fondova, hedž fondova i fondova rizičnog kapitala
- (6) Četvrti test obuhvata teoriju iz oblasti: Portfolio menadžment ostalih tipova finansijskih institucija - Portfolio menadžment firmi za HOV, investicionih banaka, finansijskih kompanija i lizing društava.

**ZAVRŠNI ISPIT**

- (7) Završni ispit (test i/ili usmeni) predstavlja konačnu provjeru znanja studenta.

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

Četiri testa koji obuhvataju teoriju i zadatke (4×10 = 40)

Seminarski rad (30)

Kviz (5)

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

**ZAVRŠNI ISPIT – 20**

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

**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:**

2020/2021

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

09.06.2020.