

## 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

### 6. Preduslovi za polaganje nastavnog predmeta:

Nema

### 7. Ograničenja pristupa:

Nema

### 8. Trajanje / semest(a)r(i):

1

7

### 9. Sedmični broj kontakt sati i ukupno studentsko radno opterećenje na predmetu:

	Semestar (1)	Semestar (2)	(za dvosemestralne predmete)	Opterećenje: (u satima)
9.1. Predavanja	4			Nastava: 67,50
9.2. Auditorne vježbe	2			Individualni rad: 141,5
9.3. Laboratorijske / praktične vježbe	0			Ukupno: 209,0

### 10. Fakultet:

Ekonomski fakultet

### 11. Odsjek / Studijski program :

Ekonomija

### 12. Nosilac nastavnog programa:

Dr. sci. Emira Kozarević, redovni profesor

### 13. 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).

#### 14. 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.

#### 15. 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

#### 16. Metode učenja:

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

#### 17. 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, kviz 5 bodova i analiza slučaja iz prakse 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.

#### 18. 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.

#### 19. Obavezna 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.

---

**20. Dopunska literatura:**

--

---

**21. Internet web reference:**

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

---

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

2024/25
---------

---

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

28.05.2024.
-------------

---