

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

6. Preduslovi za polaganje nastavnog predmeta:

Nema

7. Ograničenja pristupa:

Nema

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

1

8

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 | 5 | | | Nastava: 78,75 |
| 9.2. Auditorne vježbe | 2 | | | Individualni rad: 127,97 |
| 9.3. Laboratorijske / praktične vježbe | 0 | | | Ukupno: 206,72 |

10. Fakultet:

Ekonomski fakultet

11. Odsjek / Studijski program :

Ekonomija

12. Nosilac nastavnog programa:

Dr. sci. Meldina Kokorović Jukan, vanredni profesor

13. Ciljevi nastavnog predmeta:

Steći bazična znanja o poslovanju temeljnih tipova finansijskih institucija kao (finansijskih) firmi/preduzeća. Poseban akcenat 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.

14. Ishodi učenja:

Nakon uspješnog okončavanja ovog modula, studenti će moći/bititi 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

15. 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)
10. Integracija ESG faktora u portfolio menadžment finansijskih institucija

16. 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.

17. Objašnjenje o provjeri znanja:

PREDISPITNE 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.

18. Težinski faktor provjere:

PREDISPITNE OBAVEZE - 80

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

19. Obavezna literatura:

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

20. Dopunska literatura:

| |
|--|
| |
|--|

21. Internet web reference:

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

22. U primjeni od akademske godine:

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

23. Usvojen na sjednici NNV/UNV:

| |
|-------------|
| 28.05.2024. |
|-------------|
