

## SYLLABUS

**1. Puni naziv nastavnog predmeta:**

UPRAVLJANJE RIZICIMA PORTFOLIJA FINANSIJSKIH INSTITUCIJA

**2. Skraćeni naziv nastavnog predmeta / šifra:****3. Ciklus studija:**

3

**4. Bodovna vrijednost ECTS:**

5

**5. Status nastavnog predmeta:** Obavezni  Izborni**6. Preduslovi za polaganje nastavnog predmeta:**

Nema

**7. Ograničenja pristupa:**

Nema

**8. Trajanje / semestar:**

15

2

**9. Sedmični broj kontakt sati:**

9.1. Predavanja:

2

9.2. Auditorne vježbe:

0

9.3. Laboratorijske / praktične vježbe:

0

**10. Fakultet:**

EKONOMSKI FAKULTET

**11. Odsjek / Studijski program:**

EKONOMIJA I BIZNIS

**12. Odgovorni nastavnik:**

Dr. sc. Emira Kozarević, red. prof.

**13. E-mail nastavnika:**

emira.kozarevic@untz.ba



**14. Web stranica:**

www.ef.untz.ba

**15. Ciljevi nastavnog predmeta:**

Ovladati sofisticiranim znanjima iz oblasti upravljanja rizicima portfolija finansijskih institucija.

**16. Ishodi učenja:**

Kandidat će biti sposoban da razumije: savremena dostignuća u domenu korporativnog upravljanja rizicima, uopšte, i upravljanja rizicima portfolija finansijskih intermedijatora, posebno; doprinos tog procesa maksimizaciji bogatstva dioničara i osiguranju kontinuiteta poslovanja finansijskih intermedijatora, kao i sistemske stabilnosti; regulatorno okruženje upravljanja rizicima finansijskih intermedijatora u razvijenim tržišnim ekonomijama; upravljanje aktivom i pasivom relativno inovativnih oblika intermedijatora (poput venture capital funds, REITs, SPVs); načine hedžinga (zaštite od) rizika kojima su izloženi investitori u finansijske institucije i sl.

**17. Indikativni sadržaj nastavnog predmeta:**

1. Ključne teme savremenog korporativnog upravljanja rizicima u globalno dominantnim vrstama finansijskih intermedijatora
2. Napredni finansijski proizvodi i hedžing
3. Kako tržišni trgovci upravljaju izloženošću ("grčka slova")?
4. Rizik kamatne stope
5. Volatilnost
6. Korelacije i kopule
7. Bankarska regulacija i Bazel III
8. Regulacija osiguravajućih kompanija i Solventnost 2
9. VaR mjere
10. Tržišni VaR: pristup historijske simulacije
11. Tržišni VaR: pristup »izgradnje modela«
12. Kreditni rizik: procjena vjerovatnoća defaulta
13. Gubici po kreditnom riziku i kreditni VaR
14. Kreditni derivati
15. Operativni rizik
16. Rizik modela i rizik likvidnosti
17. Ekonomski kapital i RAROC

**18. Metode učenja:**

- ex katedra (50%)
- diskusija (30%)
- prezentacije (20%)

**19. Objašnjenje o provjeri znanja:**

- seminarski rad (izrada i prezentacija) i/ili drugi oblici aktivnosti (50%)
- završni usmeni ispit (50%)

**20. Težinski faktor provjere:**

Pregled broja bodova po provjerama znanja:

I Predispitne obaveze	50
- Pisanje i odbrana preglednog seminarskog rada/drugi oblici aktivnosti	
II Završni ispit	50

**21. Osnovna literatura:**

1. Hull, J. C. (2007) "Risk Management and Financial Institutions", Pearson Prentice Hall, New Jersey
2. Bessis, J. (2010) "Risk Management in Banking", John Wiley & Sons, Chichester
3. Schroeck, G. (2002) "Risk Management and Value Creation in Financial Institutions", John Wiley & Sons, New Jersey
4. Busch, A. (2009) "Banking Regulation and Globalization", Oxford University Press, New York
5. Gallati, R. R. (2003) "Risk Management and Capital Adequacy", McGraw-Hill, New York
6. Porteous, B. T. & Tapadar, P. (2006) "Economic Capital and Financial Risk Management for Financial Services Firms and Conglomerates", Palgrave Macmillan, New York

**22. Internet web reference:**

Naučni članci po preporuci predmetnih nastavnika.

**23. U primjeni od akademske godine:****24. Usvojen na sjednici NNV/UNV:**