

Студијски програм: Пословна економија и менаџмент (модул Управљање финансијама и ризиком)			
Назив предмета: Управљање ризиком у финансијском пословању			
Наставник: мр Драган Ј. Стојановић, предавач			
Статус предмета: Обавезни предмет			
Број ЕСПБ: 5			
Услов: - Нема услова			
Циљ предмета Циљ изучавања наставног предмета је да студенте упозна са савременом теоријом управљања ризицима у финансијском пословању, којима је могуће оптимизирати процесе за идентификовање, анализирање и управљање ризицима, као и методама за квантификовање ризика. Студенти се упознају са регулативним оквиром управљања ризиком у финансијском пословању, као и местом и улогом коришћења савремених софтверских алата у квантификацији и управљању ризиком.			
Исход предмета Знања из овог предмета треба да оспособе студенте да идентификују потенцијалне ризике у финансијском пословању, изврше њихово квантификовање, уоче последице ризика и предузму адекватне процедуре за контролу ризика. Студенти ће бити упознати са проширеним концептом управљања ризицима и са примерима коришћења савремених информационих технологија која се користе у те сврхе. На тај начин, студенти стичу способност да управљају ризицима на интелигентан начин који доприноси стварању нове			
Садржај предмета <i>Теоријска настава</i> Појам ризика у области финансијског пословања; Врсте, значај и карактеристике ризика у финансијском пословању; Појам и процес управљања ризиком у финансијском пословању; Циљеви и неопходност процеса управљања ризиком у финансијском пословању; Значај управљања ризицима у финансијском пословању; Појмовно одређење и управљање тржишним ризицима; Појмовно одређење и управљање кредитним ризиком; Појам и управљање оперативним ризиком у финансијском пословању; Управљање ризиком ликвидности, каматним ризиком и девизним ризиком у финансијском пословању; Појам и врсте VaR метода; Управљање портфељом хартија од вредности са циљем минимизирања ризика; Регулаторни оквир управљања ризицима у финансијском пословању; Управљање ризицима у пословању депозитних финансијских институција; Управљање ризицима у пословању недепозитних финансијских институција; Улога и значај примене савремених софтверских пакета за управљање ризицима. <i>Практична настава:</i> Дефинисање основних појмова повезаних са ризиком; Појам и карактеристике каматног ризика, ризика ликвидности, ризика земље, ризика репутације, законског ризика и ризика усклађености; Фазе процеса управљања ризиком у финансијском пословању; Класификација циљева управљања ризиком; Важност управљања ризицима у финансијском пословању различитих финансијских институција; Тржишни ризик, и начини његовог мерења; Модели за квантификовање кредитног ризика; Концепти мерења оперативног ризика у финансијском пословању; Ризик ликвидности, облици и компоненте каматног ризика и врсте девизног ризика; Методе квантитативног мерења ризика које се користе у оквиру VaR методе; Избор оптималног портфеља хартија од вредности применом савремених приступа у мерењу ризика; Регулаторни оквир управљања ризицима; Специфичности управљања ризицима у			
Литература : <ul style="list-style-type: none"> • Цветиновић М., <i>Управљање ризицима у финансијском пословању</i>, Универзитет Сингидунум, Београд, 2008. • Станишић М., <i>Евалуација и ризик</i>, Универзитет Сингидунум, Београд, 2011. • Crouhy M., <i>The Essentials of Risk Management</i>, McGraw-Hill Companies, 2005. 			
Број часова активне наставе	Теоријска настава: 30	Практична настава: 30	
Методe извођења наставе: Предавања, анализе случаја, дискусија, практичне самосталне вежбе			
Оцена знања (максимални број поена 100)			
Предиспитне обавезе	поена	Завршни испит	поена
активност у току предавања	5	писмени испит	
практична настава	5	усмени испит	45
колоквијум-и	30		
семинар-и	15		