

Modul	EK / PU / ST
Semestar	2
ESPB	10

UPRAVLJANJE RIZICIMA – 1D

INFOPAKET

1. Sadržaj predmeta

Cilj predmeta jeste osposobljavanje studenata da ovladaju procesima analize, savremenom metodologijom i primenom različitih metoda upravljanja rizicima u savremenom poslovanju. Usvajanje novih koncepata merenja i upravljanja rizicima razvijenih u prethodnoj deceniji. Nakon odslušane nastave na predmetu studenti će biti osposobljeni za samostalan istraživački i nastavni rad, kao i implementaciju novih metoda u oblasti merenja i upravljanja rizicima u različitim delatnostima finansijskog i realnog sektora.

2. Program predmeta

Izborni predmet

Teorijska nastava

- Teorija finansijskih rizika
- Kvantitativna analiza rizika
- Upravljanje tržišnim rizicima
- Upravljanje rizicima likvidnosti
- Upravljanje kreditnim rizicima
- Upravljanje operativnim rizicima
- Upravljanje rizicima operacija sa deriviranim instrumentima
- Integrisano upravljanje rizicima
- Evolucija regulacije upravljanja rizicima

Praktična nastava

Studijsko-istraživački rad

3. Literatura

Jorion P. Value at Risk, 3ed edition, McGraw Hill, 2007. ili novije izdanje

Jorion, P. Financial Risk Management Handbook, 2nd edition, John Wiley & Sons, 2003. ili novije izdanje

King, J. L. Operational risk: Measurement and Modelling, Wiley Finance, 2001. ili novije izdanje

Freixas, X., Rochet J. C. Microeconomic of Banking, MIT Press, 1997. ili novije izdanje

Mishkin, F.S. Prudentel supervision, The Univesity of Chicago Press, 2001.

4. Način polaganja ispita

Studijsko istraživački rad 40; Ispit 60

5. Nastavnici i kontakti

Prof. dr Dejan B. Šoškić

dejan.soskic@ekof.bg.ac.rs

dr Irena M. Janković, vanredni professor

irena.jankovic@ekof.bg.ac.rs