

|   |
|---|
| Студијски програм: Поштанске и банкарске технологије  |
| Врста и ниво студија: Основне струковне студије, први степен  |
| <b>Назив предмета: Управљање ризицима</b>   |
| Статус предмета: изборни  |
| Број ЕСПБ: 5  |
| Услов: нема   |
| <b>Циљ предмета</b>   |
| Циљ предмета је да се студент упозна са појмом и природом ризика, садржином и процесом управљања ризиком као и са корацима у процесу управљања ризиком.   |
| <b>Исход предмета</b>   |
| Након одслушаног испита студенти ће моћи, у променљивом окружењу, да идентификују и анализирају утицаје и ризик и благовремено да планирају реаговање на одређене факторе ризика и на тај начин повећају исплативост инвестиције. Такође ће моћи да учествују у раду пројектних тимова код доношења инвестиционих одлука како код сложених система на финансијском тржишту, тако и код рада на појединачним пројектима.   |
| <b>Садржај предмета</b>   |
| <i>Теоријска настава</i><br>Садржина и процес управљања ризиком: Кораци у процесу управљања ризиком (ПТТ услуга); Појам и природа ризика.<br>Концепт управљања ризиком: Идентификација ризика; Анализа и процена ризика; Планирање реакција (одговора) на ризик; Контрола примене реакције на ризике.<br>Елементи процеса одлучивања у управљању ризиком: Задачи теорије одлучивања у управљању ризиком; Структура процеса одлучивања код управљања ризиком; Однос према ризику.<br>Модел за управљање ризиком: Модел очекиване вредности одлуке; Стабло одлучивања.<br>Модел за управљање ризиком у условима неизвесности: Метод критичне тачке; Анализа осетљивости; Сценарио анализа; Примена теорије игара у теорији одлучивања.<br>Модел за управљање ризиком код инвестиционог одлучивања: Период повраћаја; Концепт временске вредности новца; Метод нето садашње вредности; Метод интерне стопе приноса; Cost – Benefit анализа.<br>Однос између ризика и исплативости инвестиција: Методи описивања ризика; Креирање плана ризика; Имплементација плана ризика; Ограничења код планирања и имплементације плана ризика.<br>Подручја изучавања управљања ризиком: Управљање ризиком (инвестиција) у предузећима; Управљање ризиком код пројеката; Управљање ризиком на финансијском тржишту; Управљање ризиком на девизном тржишту, преглед и евалуација плана ризика.<br><i>Практична настава (вежбе, ДОН, студијски истраживачки рад)</i><br>Решавање задатака применом различитих модела за управљање ризиком (стабло одлучивања, метод критичне тачке, теорија игара, модели за управљање ризиком код инвестиционог одлучивања...). |
| <b>Литература</b>   |
| <ol style="list-style-type: none"> <li>1. С. Alexander, E. Sheedy, <i>The Professional Risk Managers' Handbook: A Comprehensive Guide to Current Theory and Best Practices</i>, Wilmington, 2004, (<a href="http://www.prmia.org/Handbook.html">http://www.prmia.org/Handbook.html</a>)</li> <li>2. C.W. Smith, H.C. Smithson, S.D. Wilford, <i>Managing Financial Risk</i>, 3rd ed., McGrawHill, New York, 1998.</li> <li>3. П. Јовановић, <i>Управљање инвестицијама</i>, Графослог, Београд, 1997.</li> <li>4. Д. Ђурићин, <i>Управљање помоћу пројеката</i>, Економски институт, Београд, 1996.</li> <li>5. Р. Дубоњић, Љ. Д. Милановић, <i>Инжењерска економија</i>, ICIM плус, Крушевац, 2005.</li> </ol>   |