

<b>Студијски програм:</b> Економија и пословно управљање и Пословна информатика			
<b>Назив предмета:</b> Анализа и управљање ризицима			
<b>Наставник/наставници:</b> Дреновак М. Микица			
<b>Статус предмета:</b> студијски програм Економија и пословно управљање, изборни на модулу Менаџмент, Финансије, банкарство и осигурање и Рачуноводство, ревизија и пословне финансије; обавезан на модулу Пословна информатика			
<b>Број ЕСПБ:</b> 7			
<b>Услов:</b>			
<b>Циљ предмета</b> Основни циљ предмета Анализа и управљање ризицима је да студентима пружи знања неопходна за правовремено доношење одлука, заснована на детаљној квалитативној и квантитативној анализи фактора ризика односно неизвесности у погледу остваривања оних догађаја који могу да утичу на реализацију циљева пословања. Предвиђено градиво треба да омогући студентима да разумеју шта ризик представља за менаџера пројекта, за менаџера предузећа, како изгледа ризик у очима финансијских институција а како у очима регулатора. Студенти ће се у том циљу упознати са низом оквира и техника мерења ризика.			
<b>Исход предмета</b> Очекује се да студенти који су положили предмет Анализа и управљање ризицима разумеју/су усвојили: 1) Принципе и терминологију везану за мерење и управљање пословним и финансијским ризицима, укључујући: факторе ризика, мапирање ризика, осигурање и хедџинг ризика, диверсификацију и контролу. 2) Квантитативне методе које се користе за оцену пословних и финансијских ризика; 3) Напредне технике и праксе у управљању ризицима 4) Предности и мане квалитативног и квантитативног исказивања ризика 5) Како да се заштите од неповољних и да искористе догађаје који су повољни за постављене циљеве 6) Скуп правила, процеса, процедура и инфраструктуре којима се успоставља систем за контролу активности у сврху управљања ризицима. 7) ЕРМ оквир за интеграцију ризика			
<b>Садржај предмета</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Дефинисање ризика у контексту циљева</li> <li>• Кораци при управљању ризицима: идентификација, анализа, приоритизација, мониторинг, анализа осетљивости и одговарајуће реакције на промене околности</li> <li>• Квалитативно и квантитативно исказивања ризика- предности и мане</li> <li>• Ризик позитивног утицаја на пројекат/компанију/портфолио</li> <li>• Увођење различитих типова ризика: пословни, стратешки, финансијски, оперативни и др.</li> <li>• ЕРМ (Enterprise Risk Management) оквир који препознаје међузависности између пословних, финансијских и фактора окружења и интегрисане ризике везане за њих</li> <li>• Анализа сценарија, стрес тестови, стабла одлучивања, симулације, успостављање кључних индикатора ризика</li> <li>• Значај и примена различитих мера ризика/перформанси- мере просечног ризика, ризика екстремних квантила, перформансе у контексту преузетог ризика</li> <li>• Контекст ризика: Увођење толеранције на ризик и апетита према ризику</li> <li>• Вероватноћа остварења (не)жељених исхода и консеквенце</li> </ul>			
<b>Литература</b> Урошевић, Б., Божовић, М., <i>Операциона истраживања и квантитативне методе инвестиција</i> , Центар за издавачку делатност Економски факултет у Београду, 2009. Rausand, M., <i>Risk Assessment- Theory, Methods, and Applications</i> , Wiley, 2011 Pritchard, C., <i>Risk Management-Concepts and Guidance</i> , Fifth Edition, Taylor and Francis Group, 2015 Hillson, D., <i>Managing Risk in Projects</i> , E-book, Gower Publishing Limited, 2009 Frasier and Simkins, <i>Enterprise Risk Management</i> , Kolb Series in Finance Wiley, 2010 Benninga, S., <i>Financial Modeling</i> , The MIT Press. Cambridge, Massachusetts, 2000.			
<b>Број часова активне наставе</b>	<b>Теоријска настава: 3</b>	<b>Практична настава: 2</b>	
<b>Методe извођења наставе:</b> Теоријска настава, практична настава, самостални рад студената, консултације			
<b>Оцена знања (максимални број поена 100)</b>			
<b>Предиспитне обавезе</b>	поена	<b>Завршни испит</b>	поена
активност у току предавања	/	писмени испит	30
практична настава	/	усмени испит	/
колоквијум-и	60	.....	
семинарски	10		