

Студијски програм: Банкарство и пословна информатика
Врста и ниво студија: Основне струковне студије
Назив предмета: Управљање ризицима
Статус предмета: изборни
Број ЕСПБ: 4
Услов: нема
Циљ предмета
Циљ предмета је да студент овлада методологијом у области управљања ризиком, да се оспособи за идентификацију, анализу и процену ризичних догађаја и сценарија у различитим областима саобраћајно-транспортних делатности. Такође, да се студент оспособи за примену одговарајућих моделе управљања ризицима сходно ситуацији на тржишту.
Исход предмета:
Након одслушаног предмета 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. Студенти ће бити у стању да примене одговарајуће моделе управљања ризицима . Такође ће моћи да активно учествују у раду пројектних тимова код доношења инвестиционих одлука како код сложених система на финансијском тржишту, тако и код рада на појединачним пројектима.
Садржај предмета:
<p><i>Теоријска настава:</i></p> <p>Концепт управљања ризиком: Идентификација ризика; Анализа и процена ризика; Планирање реакција (одговора) на ризик; Контрола примене реакције на ризике.</p> <p>Елементи процеса одлучивања у управљању ризиком: Задаци теорије одлучивања у управљању ризиком; Структура процеса одлучивања код управљања ризиком; Однос према ризику.</p> <p>Модел за управљање ризиком: Модел очекиване вредности одлуке; Стабло одлучивања.</p> <p>Модел за управљање ризиком у условима неизвесности: Метод критичне тачке; Анализа осетљивости; Сценарио анализа; Примена теорије игара у теорији одлучивања.</p> <p>Модел за управљање ризиком код инвестиционог одлучивања: Период повраћаја; Концепт временске вредности новца; Метод нето садашње вредности; Метод интерне стопе приноса; Cost – Benefit анализа.</p> <p>Однос између ризика и исплативости инвестиција: Методи описивања ризика; Креирање плана ризика; Имплементација плана ризика; Ограничења код планирања и имплементације плана ризика.</p> <p>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.</p> <p><i>Практична настава</i> (вежбе, ДОН, студијски истраживачки рад)</p> <p>Решавање задатака применом различитих модела за управљање ризиком (стабло одлучивања, метод критичне тачке, теорија игара, модели за управљање ризиком код инвестиционог одлучивања, модели вишекритеријумског одлучивања ...).</p>
Литература:
<p>C. Alexander, E. Sheedy, <i>The Professional Risk Managers' Handbook: A Comprehensive Guide to Current Theory and Best Practices</i>, Wilmington, 2004, (http://www.prmia.org/Handbook.html)</p> <p>C.W. Smith, H.C. Smithson, S.D. Wilford, <i>Managing Financial Risk</i>, 3rd ed., McGrawHill, New York, 1998.</p> <p>K. Sadgrove, (2008). <i>The Complete Guide to Business Risk Management</i>, Gower Publishing, Ltd.</p> <p>П. Јовановић, <i>Управљање инвестицијама</i>, Графослог, Београд, 1997.</p> <p>Р. Дубоњић, Љ. Д. Милановић, <i>Инжењерска економија</i>, ICIM плус, Крушевац, 2005.</p>

