

DETALJNI IZVEDBENI NASTAVNI PLAN PREDMETA

OPĆE INFORMACIJE		
Naziv predmeta	Menadžment rizika	
Studijski program	Održivi razvoj turizma	
Smjer	-	
Godina studija	I	
Status predmeta	Obvezni	
Mogućnost izvođenja nastave na engleskom jeziku	Da	
Mrežna stranica predmeta	https://moodle.srce.hr/2021-2022/course/view.php?id=97907	
Bodovna vrijednost i način izvođenja nastave	ECTS koeficijent opterećenja studenata	6
	Broj sati (P+V+S)	30+0+30
Nositelj predmeta	Ime i prezime	Izv. prof. dr. sc. Goran Karanović
	Kabinet	
	Konzultacije OPATIJA: Ponedjeljak 10,00 – 12,00 Srijeda 15,00 – 17,00 ZABOK:	
	Telefon	051/294-693
	e-mail	gorank@fthm.hr
Suradnik na predmetu	Ime i prezime	-
	Kabinet	-
		-
	Telefon	-
	e-mail	-
OPIS PREDMETA		
Ciljevi predmeta		
<p>Opći cilj ovog predmeta je osposobiti studente za proaktivno i sveobuhvatno promišljanje o rizicima u cilju održivog financijskog poslovanja subjekata te za pravilnu primjenu alata menadžmenta rizika. Specifični cilj ovog predmeta je osposobiti studente za primjenu osnovnih i specifičnih tehnika, metoda i instrumenata za mjerenje rizika i upravljanje rizicima u kontekstu financijskog poslovanja. Kroz ovaj predmet polaznicima će se omogućiti neposredno iskustvo korištenja nekoliko tehnika, metoda i alata za prepoznavanje, analizu, kvantifikaciju i upravljanje rizicima u kontekstu održivog financijskog poslovanja. Predmet je fokusiran na upoznavanje teorije menadžmenta rizika, a poseban naglasak bit će na praktičnoj primjeni i rješavanju problema uz pomoć alata menadžmenta rizika. Sudjelovanjem u aktivnostima ovog predmeta i nakon položenog ispita studenti će biti sposobni koristiti alate menadžmenta rizika za održivo upravljanje poslovnim subjektom.</p>		
Očekivani ishodi učenja za predmet		
<p>Očekuje se da studenti nakon položenog ispita predmeta Menadžment rizika mogu:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Pravilno opisati i interpretirati temeljne pojmove rizika i različita teorijska shvaćanja rizika, 2. Usporediti te razlikovati bihevioralno i racionalno poimanje ponašanja te interpretirati utjecaj na analizu rizika 3. Analizirati i opisati načela, procese i okvir menadžmenta rizika, 4. Prepoznati, interpretirati, analizirati i izraditi različite strategije i politike upravljanjem rizika u cilju održivog financijskog poslovanja, 5. Koristiti kvalitativne i kvantitativne metode za mjerenje rizika (npr. Mape rizika, Delfi, Standardna devijacija, VaR, Monte Carlo simulacija, stablo odlučivanja, scenarija, CAMP i dr.) i pravilno tumačiti rezultate, 6. Izraditi optimalan model za upravljanje rizicima u financijskom poslovanju na konkretnom slučaju, 		



7. Provesti i interpretirati izračune i mjerenja rizika u financijskom poslovanju te u procesu budžetiranja kapitala,
8. Provesti i interpretirati izračune i mjerenja rizika za financijski portfolio,
Osmisliti i pravilno predložiti mjere za optimalno upravljanje rizicima u cilju održivog financijskog poslovanja.

Vrste izvođenja nastave

Predavanja, seminari i radionice, samostalni zadaci i obrazovanje na daljinu

Obveze studenata i način vrednovanja obveza (povezivanje ishoda učenja, nastavnih metoda i ocjenjivanja)

<i>Vrsta aktivnosti</i>	<i>ECTS dodijeljen aktivnosti</i>	<i>Ishod učenja</i>	<i>Aktivnost studenta</i>	<i>Metoda ocjenjivanja</i>	<i>Bodovi (maximum po vrijednosti)</i>
Pohađanje nastave	2,0	1-9	Prisustvo: >75%	Evidencija prisutnosti na nastavi	0
Samostalni rad studenta (nabrojati i opisati sve aktivnosti) npr.					Ukupan zbroj ovih aktivnosti treba iznositi 22
Studija slučaja	1,5	5-8	Izrada studije slučaja te prezentacija i javna obrana.	Pismeni dio detaljno obrazloženo u uputama – Široki kriteriji	8
				Usmeni dio detaljno obrazloženo u uputama – Široki kriteriji	8
Grupni rad (Think-Pair-Share)	0	1-9	Rješavanje problemskog zadatka u grupi	Predstavljanje rješenja praktičnog zadatka - Globalni	6
Kontinuirana provjera znanja (kolokviji)	1,5	1- 9	Priprema za periodičnu provjeru znanja	0-48 bodova Broj bodova po pojedinom kolokviju određuje nastavnik (ukupno dva kolokvija)	1. kolokvij 24 2. kolokvij 24
Završni ispit	1,0	1- 9	Priprema za završni ispit	0-30 bodova	30
Ukupno ECTS	9			Ukupno bodovi	100

Napomene i opis aktivnosti

a) Opis aktivnosti za Studiju slučaja - Izračun Beta koeficijenta, Value at Risk (VaR) za portfelj i Monte Carlo Modela

Točnim rješavanjem studije slučaja moguće je ostvariti 16% (8% iz pismenog dijela, 8% iz obrane). Cilj ove studije slučaja je izračunati β -koeficijent za vrijednosnice određene kompanije i β -koeficijent za portfelj te protumačiti dobivene rezultate te je



potrebno izračunati VaR za portfelj prema unaprijed utvrđenim kriterijima i primijeniti Monte Carlo Model.

ZADATAK – detaljno opisan u materijalima dostupnim na Merlinu

BODOVANJE – detaljno opisano u materijalima dostupnim na Merlinu

FORMA DOKUMENATA I DOSTAVLJANJE

1. Potrebno je dostaviti na e-mail adresu nositelja kolegija, najkasnije do pet dana prije roka za prezentaciju, koja će biti naknadno dogovorena na satu, i to sljedeće dokumente:
 - a. Excel dokument iz kojeg su vidljivi izračuni te rezultati β -koeficijenta, VaRa i Monte Carlo modela,
 - b. Word dokument u kojem su obrazloženi rezultati i prikazani grafički (forma seminarskog rada, ali opseg do maksimalno 4 stranice)

FORMA PREZENTACIJE

Potrebno je izraditi prezentaciju koju nije potrebno slati na e-mail.

BODOVANJE PREZENTACIJE

Izlaganje i obrana prezentacija studije slučaja boduje se na sljedeći način. Da bi student ostvario ishode učenja i dobio bodove tj. bio pozitivno ocjenjen iz prezentacije studije slučaja potrebno je da iz svake rubrike ostvari minimalno pozitivno ucjenu (2 ili 3 ili 4 ili 5).

Rad u grupi (Think, Pair, Shair) – grupni rad na problemskom zadatku izrade matrice rizika. BODOVANJE – detaljno opisano u materijalima dostupnim na Merlinu

- b) **Kolokvij** - održavaju se u usmenoj formi, pri čemu se sastavlja zapisnik o održanom usmenom ispitu, tablica ispod čini sastavni dio zapisnika. Ukupno se održavaju dva kolokvija. Kolokvij se provodi na način da student izvlači list - grupu s četiri pitanja. Svako pitanje boduje se maksimalno sa šest bodova tj. 24 boda po kolokviju. Ukupno kolokvijima nose 48 bodova
- c) **Ispiti (I.,II. I III.)** može biti u pismenom ili usmenom obliku te nose 30 bodova.

Student na ispitu može ostvariti maksimalno 30% ocjenskih bodova. Ispitu može pristupiti student koji je tijekom nastave ostvario 35 % i više ocjenskih bodova. Uvjet za pristupanje ispitu redovitim studentima je minimalno ostvarenih 75% prisutnosti na nastavi. Studentu koji nije pristupio ispitu neće biti iskazana ECTS ocjena. Ispitni prag na ispitu ne može biti manji od 50% uspješno riješenog ispita.

Sustav ocjenjivanja

Ocjenjivanje i vrednovanje rada studenata tijekom nastave i na završnom ispitu provodi se temeljem Pravilnika o ocjenjivanju studenata na FMTU.

LITERATURA

Obvezna literatura

Sajter, Domagoj. *Osnove upravljanja rizicima u financijskim institucijama*. 2017. Osijek: Ekonomski fakultet u Osijeku.
Grgurek, Ivo i Zvonko Merkaš. *Upravljanje poslovnim rizicima*. 2016. Zagreb: Libertas – Plejada.

Dopunska literatura

Miloš Sprčić, Danijela. *Upravljanje rizicima: Temeljni koncepti, strategije i instrumenti*. 2013. Zagreb: Sinergija.
Karanović, Goran. *Skripta*. 2016. Opatija.

Način praćenja kvalitete i uspješnosti izvedbe predmeta

Kvaliteta održane nastave prati se u skladu s aktima Sveučilišta u Rijeci. U zadnjim tjednima nastave tekućega semestra provodit će se anonimna anketa u kojoj će studenti evaluirati kvalitetu održane nastave iz ovog predmeta.

ISPITNI ROKOVI

Raspored ispitnih rokova dostupan je na linku: <https://www.fthm.uniri.hr/studiji/diplomski-sveucilisni-studij/ispiti>



DODATNE INFORMACIJE O PREDMETU

Način informiranja studenta

Studenti dobivaju obavijesti o kolegiju putem sustava Merlin i mrežnih stranica Fakulteta

<https://www.fthm.uniri.hr/>,

Redovita informiranost je osobna odgovornost studenta.

RASPORED NASTAVE

REDOVITI STUDIJ

Nastava na predmetu odvijat će se prema sljedećem rasporedu:

R. br.	Datum / vrijeme od – do / dvorana	Vrsta i oblik nastave	Tema	Grupa	Izvoditelj
1.	06.10.2020 11:00-13:40 Dvorana C1	P onsite	Upoznavanje s literaturom Prezentacija nastavnih cjelina i opterećenje po kolokvijima Prezentacija bodovanja aktivnosti tijekom nastave i na ZI Uvodno predavanje Rizik, menadžment rizika, objektivnost, subjektivnost, primjena upravljanja rizicima i dr.		G. Karanović
		S onsite	Zadavanje studija slučajeva te datuma izvršenja studija slučajeva Primjer – demonstracija studije slučaja		G. Karanović
2.	13.10.2021 11:00-13:40 Dvorana C1	P onsite	Rizik i neizvjesnost, Definicija i etimologija riječi rizik, Vjerojatnost, Vrste rizika, Stavovi o riziku,		G. Karanović
		S onsite	Primjer – demonstracija studije slučaja		G. Karanović
3.	20.10.2021 11:00-13:40 Dvorana C1	P onsite	Volatilnost, Sharpeov omjer, Informacijski omjer, Beta, Alfa, R ² ,		G. Karanović
		S onsite	Obrane studija slučaja		G. Karanović
4.	27.10.2021 11:00-13:40 Dvorana C1	P onsite	Vrste rizika, tretiranje rizika, moralni hazard,		G. Karanović
		S onsite	Obrane studija slučaja		G. Karanović
5.	03.11.2021 11:00-13:40 Dvorana C1	P onsite	Rizična vrijednost (VAR), Korištenje EFT-ova pri upravljanju rizicima		G. Karanović
		S onsite	Obrane studija slučaja		G. Karanović
6.	10.11.2021 11:00-13:40 Dvorana C1	P onsite	Monte Carlo simulacija, Rizična vrijednost (VAR)		G. Karanović
		S onsite	Obrane studija slučaja		G. Karanović
7.	17.11.2021 11:00-13:40 Dvorana C1	P onsite	Gost predavač – Upravljanje financijskim rizicima		G. Karanović
		S onsite	Obrane studija slučaja		G. Karanović
8.	24.11.2021 11:00-13:40 Dvorana C1	P onsite	1. kolokvij		G. Karanović
		S onsite	Obrane studija slučaja		G. Karanović
9.	01.12.2021 11:00-13:40 Dvorana C1	P onsite	Podjela rizika, Specifični rizici, Poslovni rizici s obzirom na djelatnost		G. Karanović
		S onsite	Obrane studija slučaja		G. Karanović
10.	08.12.2021 11:00-13:40 Dvorana C1	P onsite	Metode za procjenu, Mapiranje rizika		G. Karanović
		S onsite	Obrane studija slučaja		G. Karanović
11.	15.12.2021 11:00-13:40 Dvorana C1	P onsite	Kvantitativna i kvalitativna analiza rizika		G. Karanović
		S onsite	Obrane studija slučaja		G. Karanović
12.	22.12.2021	P onsite	Kvantitativna i kvalitativna analiza rizika		G. Karanović

	11:00-13:40 Dvorana C1	S onsite	Obrane studija slučaja		G. Karanović
13.	12.01.2022 11:00-13:40 Dvorana C1	P onsite	Mjerenje tržišnih rizika u proizvodnji, trgovini i bankarstvu		G. Karanović
		S onsite	Obrane studija slučaja		G. Karanović
14.	19.01.2022 11:00-13:40 Dvorana C1	P onsite	Menadžment rizika u turizmu		G. Karanović
		S onsite	Obrane studija slučaja		G. Karanović
15.	26.01.2022 11:00-13:40 Dvorana C1	P onsite	2. kolokvij		G. Karanović
		S onsite	Obrane studija slučaja		G. Karanović

IZVANREDNI STUDIJ OPATIJA

Nastava na predmetu odvijat će se prema sljedećem rasporedu:

R.br.	Datum / vrijeme od – do / dvorana	Vrsta i oblik nastave	Tema	Izvoditelj
1.	06.10.2021. 17:00– 21:00	P online	Upoznavanje s literaturom Prezentacija nastavnih cjelina i opterećenje po kolokvijima Prezentacija bodovanja aktivnosti tijekom nastave i na ZI Uvodno predavanje Rizik, menadžment rizika, objektivnost, subjektivnost, primjena upravljanja rizicima i dr. Rizik i neizvjesnost, Definicija i etimologija riječi rizik, Vjerojatnost, Vrste rizika, Stavovi o riziku, Volatilitnost, Sharpeov omjer, Informacijski omjer, Beta, Alfa, R ² .	
		S online	Zadavanje studija slučajeva te datuma izvršenja studija slučajeva Primjer – demonstracija studije slučaja	
2.	27.10.2021. 17:00– 21:00 Dvorana C1	P onsite	Vrste rizika, tretiranje rizika, moralni hazard, Rizična vrijednost (VAR), Korištenje EFT-ova pri upravljanju rizicima, Monte Carlo simulacija, Rizična vrijednost (VAR), Podjela rizika, Specifični rizici, Poslovni rizici s obzirom na djelatnost	
		S onsite		
3.	17.11.2021. 17:00– 21:00 Dvorana C1	P onsite	Metode za procjenu, Mapiranje rizika, Kvantitativna i kvalitativna analiza rizika, Kvantitativna i kvalitativna analiza rizika, Mjerenje tržišnih rizika u proizvodnji, trgovini i bankarstvu, Menadžment rizika u turizmu, Mjerenje tržišnih rizika u proizvodnji, trgovini i bankarstvu,	
		S onsite	Obrane studija slučaja	
4.	08.12.2021. 17:00– 21:00	P online	1. kolokvij Menadžment rizika u turizmu	
		S online	Obrane studija slučaja	
5.	12.01.2022. 17:00– 21:00 Dvorana C1	P onsite	2. kolokvij	
		S onsite	Obrane studija slučaja	