

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		
Mrežna stranica predmeta	https://moodle.srce.hr/2022-2023/course/view.php?id=135255	
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	202
	Konzultacije	OPATIJA: OPATIJA: Ponedjeljak 10,00 – 12,00 Srijeda 15,00 – 17,00
	ZABOK:	-
	Telefon	
	e-mail	
Suradnik na predmetu	Ime i prezime	
	Kabinet	
	Telefon	
	e-mail	
OPIS PREDMETA		
Ciljevi predmeta		
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.		
Očekivani ishodi učenja za predmet		
Očekuje se da studenti nakon položenog ispita predmeta Menadžment rizika mogu:		
<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,
9. 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	Evidencija prisutnosti na nastavi	0
Studija slučaja 1	1,0	5-8	Izrada studije slučaja te prezentacija i javna obrana.	Pismeni dio detaljno obrazloženo u uputama – Široki kriteriji	5
				Usmeni dio detaljno obrazloženo u uputama – Široki kriteriji	10
Studija slučaja 2	0,4	5-8	Izrada studije slučaja te prezentacija i javna obrana.	Pismeni dio detaljno obrazloženo u uputama – Široki kriteriji Usmeni dio detaljno obrazloženo u uputama – Široki kriteriji	5
Grupni rad (Think-Pair-Share)	0,1	1-9	Rješavanje problemskog zadatka u grupi	Predstavljanje rješenja praktičnog zadatka - Globalni	5
					5
Kontinuirana provjera	1,5	1- 9	Priprema za	0-48 bodova	1. kolokvij 20

znanja (kolokviji)			periodičnu provjeru znanja	Broj bodova po pojedinom kolokviju određuje nastavnik (ukupno dva kolokvija)	2. kolokvij 20
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 1 - Izračun Beta koeficijenta, Value at Risk (VaR) za portfelj

Točnim rješavanjem studije slučaja moguće je ostvariti 15% (5% iz pismenog dijela, 10% 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

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:

- Excel dokument iz kojeg su vidljivi izračuni te rezultati β -koeficijenta, VaR,
- 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).

b) Opis aktivnosti za Studiju slučaja 2 – Izrada registra rizika na konkretnom primjeru poduzeća

Točnim rješavanjem studije slučaja 2 moguće je ostvariti 5% . Cilj ove studije slučaja je samostalno izraditi registar rizika na konkretnom primjeru. **BODOVANJE – detaljno opisano u materijalima dostupnim na Merlinu**

ZADATAK – detaljno opisan u materijalima dostupnim na Merlinu

BODOVANJE – detaljno opisano u materijalima dostupnim na Merlinu

c) **Rad u grupi (Think, Pair, Shair)** – grupni rad na problemskom zadatku bodovanja rizika te izrade matrice rizika. Točnim rješavanjem studije slučaja moguće je ostvariti 10% (5% iz pismenog dijela, 5% iz obrane). **BODOVANJE – detaljno opisano u materijalima dostupnim na Merlinu**

ZADATAK – detaljno opisan u materijalima dostupnim na Merlinu

BODOVANJE – detaljno opisano u materijalima dostupnim na Merlinu

FORMA DOKUMENATA I DOSTAVLJANJE

2. Potrebno je dostaviti na e-mail adresu nositelja kolegija, najkasnije do pet dana prije roka za prezentaciju, koja će biti naknadno dogovorena na satu,

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).

- d) **Kolokvij** - održavaju se u usmenoj formi, pri čemu se sastavlja zapisnik o održanom usmenom ispitu (tablica s ocjenama), koja 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 pet bodova odnosno ukupno 20 boda po kolokviju. Ukupno kolokviji nose 40 bodova
- e) **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. 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*. 2021. 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

Ne unose se termini nego sljedeći tekst:

Za preddiplomski studij:

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

Za diplomski studij:

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

IZVANREDNI STUDIJSKI

Nastava na predmetu odvijat će se prema sljedećem rasporedu:

R.	Datum /	Vrsta i oblik	Tema	Grupa	Izvoditelj
----	---------	---------------	------	-------	------------

br.	vrijeme od – do / dvorana	nastave		
1.	03.10.2022 19:30-21:00 Dvorana A6	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.	G. Karanović
		S online	Zadavanje studija slučajeva te datuma izvršenja studija slučajeva Primjer – demonstracija studije slučaja	G. Karanović
2.	04.10.2022 18:00-21:00 Dvorana A6	P online	Rizik i neizvjesnost, Definicija i etimologija riječi rizik, Vjerojatnost, Vrste rizika, Stavovi o riziku,	G. Karanović
		S online	Primjer – demonstracija studije slučaja	G. Karanović
3.	05.10.2022 19:30-21:00 Dvorana A6	P online	Volatilnost, Sharpeov omjer, Informacijski omjer, Beta, Alfa, R ² ,	G. Karanović
		S online	Obrane studija slučaja	G. Karanović
4.	06.10.2022 18:00-21:00 Dvorana A6	P online	Vrste rizika, tretiranje rizika, moralni hazard,	G. Karanović
		S online	Obrane studija slučaja	G. Karanović
5.	07.10.2022 19:30-21:00 Dvorana A6	P online	Rizična vrijednost (VAR), Korištenje EFT-ova pri upravljanju rizicima	G. Karanović
		S online	Obrane studija slučaja	G. Karanović
6.	12.10.2022 18:00-21:00 Dvorana A6	P online	Monte Carlo simulacija, Rizična vrijednost (VAR)	G. Karanović
		S online	Obrane studija slučaja	G. Karanović
7.	11.10.2022 19:30-21:00 Dvorana A6	P online	Gost predavač – Upravljanje financijskim rizicima	G. Karanović
		S online	Obrane studija slučaja	G. Karanović
8.	12.10.2022 18:00-21:00 Dvorana A6	P online	Podjela rizika, Specifični rizici, Poslovni rizici s obzirom na djelatnost	G. Karanović
		S online	Obrane studija slučaja	G. Karanović
9.	13.10.2022 19:30-21:00 Dvorana A6	P online	Metode za procjenu, Mapiranje rizika	G. Karanović
		S online	Obrane studija slučaja	G. Karanović
10.	14.10.2022 18:00-21:00 Dvorana A6	P online	Kvantitativna i kvalitativna analiza rizika	G. Karanović
		S online	Obrane studija slučaja	G. Karanović
11.	22.10.2022 12:30-13:30	P online	1. Kolokvij - ZABOK	G. Karanović
		S online	Obrane studija slučaja	G. Karanović
	24.10.2022 19:30-20:30 Dvorana A6	P online	1. Kolokvij - OPATIJA	G. Karanović
		S online	Obrane studija slučaja	G. Karanović
12.	25.10.2022 18:00-21:00 Dvorana A6	P online	Kvantitativna i kvalitativna analiza rizika	G. Karanović
		S online	Obrane studija slučaja	G. Karanović
13.	26.10.2022	P online	Mjerenje tržišnih rizika u proizvodnji, trgovini i bankarstvu	G. Karanović

	19:30-21:00 Dvorana A6	S online	Obrane studija slučaja		G. Karanović
14.	27.11.2022 18:00-19:15 Dvorana A6	P online	Menadžment rizika u turizmu		G. Karanović
		S online	Obrane studija slučaja		G. Karanović
15.	04.11.2022 19:30-20:30 Dvorana A6	P online	2. kolokvij - OPATIJA		G. Karanović
		S online	Obrane studija slučaja		G. Karanović
	05.11.2022 12:30-13:30	P online	2. kolokvij - ZABOK		G. Karanović
		S online	Obrane studija slučaja		G. Karanović