TANTÁRGYI ADATLAP

A KOCKÁZATMENEDZSMENT ALAPJAI

BMEGT35M101

I. TANTÁRGYLEÍRÁS

1. ALAPADATOK

Tantárgy neve
A KOCKÁZATMENEDZSMENT ALAPJAI

Azonosító BMEGT35M101

A tantárgy jellege
kontaktórás tanegység

Kurzustípusok és óraszámok

Típus	*óraszám*
Előadás	4
Gyakorlat	0
Laboratórium	0

Tanulmányi teljesítményértékelés (minőségértékelés) típusa
vizsgaérdemjegy

Kreditszám
5

Tantárgyfelelős

Neve	*Beosztása*	*Email címe*
Dr. Bethlendi András	egyetemi docens	bethlendi.andras@gtk.bme.hu

Tantárgyat gondozó oktatási szervezeti egység
Pénzügyek Tanszék

A tantárgy weblapja

A tantárgy oktatásának nyelve
angol - ENG

A tantárgy tantervi szerepe, ajánlott féléve

Közvetlen előkövetelmények

Erős	Nincs
Gyenge	Nincs
Párhuzamos	Nincs
Kizáró feltételek	Nincs

A tantárgyleírás érvényessége
Jóváhagyta a Gazdaság- és Társadalomtudományi Kar Kari Tanácsa (2023.10.25.) az 580672/5/2023 iktatószámon hozott határozatával, amely érvényes 2023.10.25-től.

2. CÉLKITŰZÉSEK ÉS TANULÁSI EREDMÉNYEK

Célkitűzések

Az üzleti döntéseket jelentős üzleti bizonytalanság, ill. kockázat övezi. A tárgy oktatásának az a célja, hogy a hallgató megismerkedjen a kockázatkezelés alapkoncepciójával. Milyen típusú kockázatokkal szembesülnek a vállalatok és pénzintézetek. A kockázatkezelés, ill. tágabban a felelős vállalatirányítás hogyan tudja ezeket hatékonyan kezelni, mely által növeli a szervezet értékét. A hallgatók képet kapnak a kockázatkezelés alapvető módszereiről és legjobb gyakorlatairól, ezek közül kiemelten: value at risk; expected shortfall; stressz teszt és szcenário elemzés. A piaci koc-kázatokat az opció és kötvény árazási modelleken keresztül mutatjuk be (ezen pénzügyi instrumentumok milyen kockázatok érzékenyek). Ismertetjük a hitelkockázatot, ill. annak két alkotóelmét: a várt és nem várt veszteséget. Kité-rünk a működési és szuverén kockázatokra is. A tematika kidolgozásánál nagymértékben törekedtünk arra, hogy a nemzetközi FRM (Financial Risk Manager) vizsga első és negyedik témaköreit (Foundations of Risk Management; Valuation and Risk Models) lefedjük. Az okta-tás során azt a célkitűzést tartjuk szem előtt, hogy a tanulási folyamat eredményeképpen a hallgató képes legyen az elsajátított elmélet gyakorlatban történő alkalmazására

Tanulmányi eredmények

Tudás

1. a különböző kockázattípusokat;
2. alapvető kockázatkezelési módszereket;
3. a modern vállalatirányítási rendszereket, melyben a kockázatkezelési funkció is szerepet kap;
4. a kockázatcsökkentő technikákat.

Képesség

1. az önálló tanulás megtervezésére, megszervezésére és végzésére,
2. a téma szakirodalmi forrásainak megértésére és feldolgozására,
3. a vállalati/banki kockázat felismerésére és mérésére,
4. a döntéshozatalt támogató számítások elvégzésére.

Attitűd

1. nyitott a pénzügyi szakterület innovációinak megismerésére és adaptálására
2. a tanulás során együttműködik oktatóval és hallgató társaival,
3. gyarapítja tudását és tájékozódik,
4. használja az IT eszközök által kínált lehetőségeket.

Önállóság és felelősség

1. nyitott a megalapozott kritikai észrevételek elfogadására,
2. a tanulás során együttműködik hallgatótársaival a feladatok megoldásában,
3. a pénzügyi (kockázati) döntések során képes megalapozottan mérlegelni,
4. átlátja a felelősségvállalás súlyát és jelentőségét, fel tudja mérni a döntések következményeit.

Oktatásmódszertan

Előadások, kommunikáció írásban és szóban, IT eszközök és technikák használata, opcionális önállóan és csoport-munkában készített feladatok.

Tanulástámogató anyagok

- Az előadások prezentációinak anyaga, ami a félév során folyamatosan fog feltöltésre kerülni.
- Lecture slides which will be uploaded continously during the semester.
- Az aktuális irodalmi lista az első órán kerül ismertetésre.
- The actual bibliography will be presented in the first hour

II. TANTÁRGYKÖVETELMÉNYEK

A TANULMÁNYI TELJESÍTMÉNY ELLENŐRZÉSE ÉS ÉRTÉKELÉSE

Általános szabályok

A 2.2. pontban megfogalmazott tanulási eredmények értékelése vizsga alapján történik. Az értékelésben megjelenik a nem kötelező házi
feladat helyes megoldása.

Teljesítményértékelési módszerek

A. Szorgalmi időszakban végzett teljesítményértékelések részletes leírása A hallgatók házi feladat készítéssel plusz pontszámot szerezhetnek. A vizsgára bocsáthatóság és az aláírás feltétele: a tanórák 70%-án való részvétel. B. Vizsgaidőszakban végzett teljesítményértékelések
A tárgyi tudás és képesség kompetenciaelemeinek értékelése írásos formában a vizsgaidőszakban történik. Az értékelés alapjául szolgáló
tananyagrészt a tantárgy előadója határozza meg. A vizsgán rendelkezésre álló idő a szemeszter során kerül kihirdetésre.

Szorgalmi időszakban végzett teljesítményértékelések részaránya a minősítésben

Vizsgaelemek részaránya a minősítésben

Az aláírás megszerzésének feltétele, az aláírás érvényessége

Az aláírás megszerzésének feltétele az előadások látogatása. A vizsga megírásának feltétele az aláírás megszerzése. A megszerzett aláírás
a TVSZ szerinti időtartamig érvényes

Érdemjegy-megállapítás

Jeles	91
Jeles	86-90
Jó	71-85
Közepes	61-70
Elégséges	51-60
Elégtelen	50

Javítás és pótlás

Javítás és pótlás TVSZ szerint történik

A tantárgy elvégzéséhez szükséges tanulmányi munka

részvétel a kontakt tanórákon	56
házi feladatok	10
vizsgafelkészülés	84
összesen	150

A tantárgykövetelmények jóváhagyása és érvényessége

A Kari Hallgatói Képviselet véleményezése után jóváhagyta dr. Lógó Emma oktatási dékánhelyettes 2023.10.09-én. Érvényes 2023.10.09-től.

III. RÉSZLETES TANTÁRGYTEMATIKA

TEMATIKAI EGYSÉGEK ÉS TOVÁBBI RÉSZLETEK

A félévben sorra vett témák

Subject includes the topics detailed in the course syllabus to ensure learning outcomes listed under 2.2. can be achieved. Timing of the topics will be arranged by the calendar or other circumstances in each semester.

További oktatók

Szallerné Sereg Nikoletta tanársegéd sereg.nikolett@gtk.bme.hu

A tantárgykövetelmények jóváhagyása és érvényessége

A Tantárgyi adatlap I. és II. részén túli III. részét az érintett szak(ok) szakfelelőse(i)vel való egyeztetés alapján az 1.8. pontban megjelölt Pénzügyek Tanszék vezetője hagyja jóvá.