



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

<i>Típus</i>	<i>óraszám</i>
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

Szak: Pénzügy MSc (angol nyelven) 2019/20/1 félévtől ŐSZI kezdés

Tantárgy szerepe: **Kötelező**

Ajánlott félév: **1**

Szak: Pénzügy MSc (angol nyelven) 2019/20/1 félévtől TAVASZI kezdés

Tantárgy szerepe: **Kötelező**

Ajánlott félév: **2**

Közvetlen előkövetelmények

Erős Nincs

Gyenge Nincs

Párhuzamos Nincs

Kizáró feltételek Nincs

A tantárgyleírás érvényessége

Jóváhagyta a Gazdaság- és Társadalomtudományi Kar Kari Tanácsa 580417/2/2018 iktatószámmon hozott 2. számú határozatával, érvényes 2018. június 27-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 pénzüzetek. 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 scenárió elemzés. A piaci koc-kázatok 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 continuously 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 készítésével plusz pontszámot szerezhettek. 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

- házi /szorgalmi feladat : elérhető: 5 x 2 pont (10%) – achievable: 5 x 2 points (10%)

Vizsgaelemek részaránya a minősítésben

- Év végi írásbeli vizsga : 100%

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	90
Jeles	80-90
Jó	70-80
Közepes	60-70
Elégéséges	40-60
Elégtelen	40

Javítás és pótlás

Javítás és pótlás TVSZ szerint történik

A tantárgy elvégzéséhez szükséges tanulmányi munka

részvétel a kontakt tanórákon	28×2=56
házi feladatok	10
vizsgafelkészülés	84
összesen	150

A tantárgykövetelmények jóváhagyása és érvényessége

A Kari Hallgatói Képviselőtestület véleményezése után jóváhagyta dr. Lógó Emma oktatási dékánhelyettes, érvényes 2018. június 27-től.

III. RÉSZLETES TANTÁRGYTEMATIKA

TEMATIKAI EGYSÉGEK ÉS TOVÁBBI RÉSZLETEK

A félévben sorra vett témák

A 2.2. pontban megfogalmazott tanulási eredmények eléréséhez a tantárgy a következő tematikai blokkokból áll. Az egyes félévekben meghirdetett kurzusok sillabuszaiban e témaelemeket ütemezzük a naptári és egyéb adottságok szerint.

1

További oktatók

A tantárgykövetelmények jóváhagyása és érvényessége

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