

FIȘA DISCIPLINEI

1. Date despre program

1.1 Instituția de învățământ	UNIVERSITATEA CREȘTINĂ PARTIUM
1.2 Facultatea	FACULTATEA DE ȘTIINȚE ECONOMICE ȘI SOCIALE
1.3 Departamentul	DEPARTAMENTUL DE ECONOMIE
1.4 Domeniul de studii	MANAGEMENT
1.5 Ciclul de studii	MASTER
1.6 Programul de studii/Calificarea	MANAGEMENTUL DEZVOLTĂRII AFACERILOR

2. Date despre disciplină

2.1 Denumirea disciplinei	MANAGEMENTUL RISCULUI IN AFACERI (MDA2201)
2.2 Titularul activității de curs	conf. univ. dr. Tibor Tarnóczy
2.3 Titularul activității de seminar	lector dr. Edina Kulcsár
2.4 Anul de studiu	II
2.5 Semestrul	IV
2.6 Tipul de evaluare	Examen
2.7 Regimul disciplinei	Disciplină obligatorie

3. Timpul total estimat

3.1 Număr de ore pe săptămână	4 ore	din care 3.2 curs	2 ore	3.3 seminar/laborator	2 ore
3.4 Total ore din planul de învățământ	56 ore	din care 3.5 curs	28 ore	3.6 seminar/laborator	28 ore
Distribuția fondului de timp					Ore
Studiul după manual, suport de curs, bibliografie și notițe					50 ore
Documentare suplimentară în bibliotecă, pe platforme electronice de specialitate și pe teren					31 ore
Pregătire seminarii/laboratoare, teme, referate, portofolii și eseuri					25 ore
Tutoriat					5 ore
Examinări					8 ore
Alte activități...					-
3.7 Total ore studiu individual					119 ore
3.8 Total ore pe semestru					175 ore
3.9 Numărul de credite					7

4. Precondiții (acolo unde este cazul)

4.1 de curriculum	-
4.2 de competențe	-

5. Condiții (acolo unde este cazul)

5.1 de desfășurare a cursului	Sală de curs dotată cu instrumente moderne de prezentare
5.2 de desfășurare a seminarului/laboratorului	Sală de laborator dotată cu tablă

6. Competențe specifice acumulate

Competențe profesionale	Cunoștințe: C1.1 Identificarea și dobândirea conceptelor și noțiunilor privind managementul riscului; C1.2 Utilizarea terminologiilor de managementul riscului în limba maghiară. Abilități C1.3 Însușirea și aplicarea principiilor fundamentale acumulate la disciplina managementul riscului; C1.4. Dezvoltarea capacității de a aplica creativ cunoștințele dobândite la disciplina managementul riscului;
Competențe transversale	CT1. Aplicarea principiilor, normelor și valorilor eticii profesionale in cadrul propriei strategii de munca riguroasă, eficientă și responsabilă. CT2. Identificarea rolurilor și responsabilităților într-o echipă plurispecializată și aplicarea de tehnici de relaționare și muncă eficientă cadrul echipei.

7. Obiectivele disciplinei (reieșind din grila competențelor specifice acumulate)

7.1 Obiectivul general al disciplinei	▪ Posibilitatea corelării cunoștințelor teoretice cu cele practice; ▪ Formarea unui raționament profesional al studenților prin însușirea principalelor surse de finanțare ale societății comerciale; ▪ Dezvoltarea capacității studentului de a lua o decizii consecvente la nivelul firmei și de dezvoltare a strategiilor financiare;
7.2 Obiectivele specifice	Competențe cognitive: ▪ Dezvoltarea gândirii financiare; ▪ Dezvoltare capacității de luare a deciziilor; ▪ Ridicarea nivelului de comunicare la nivelul firmei; ▪ Dezvoltarea abilităților de calcul; Competențe profesionale: ▪ Dezvoltarea capacității de înțelegere a proceselor financiare; ▪ Creșterea nivelului de acuratețe al fundamentării deciziilor financiare; ▪ Dezvoltarea abilităților de identificare și interpretare a corelațiilor financiare; ▪ Dezvoltarea gândirii de sistem și abilității de fundamentare a deciziilor; ▪ Întărirea abilităților de modelare; Competențe emoționale: ▪ Încurajarea muncii în echipă; ▪ Îmbunătățirea realizărilor proprii; ▪ Dezvoltarea abilității de adaptare la schimbare;

8. Conținuturi

8.1 Curs	Metode de predare	Nr.ore/ Observații
1. Conceptul de risc. Risc și incertitudine. Riscul economic Bibliografie: Farkas Sz. – Szabó J.: Kockázati menedzsment. PMS 2000 Kft, 2003. Hull, J. C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb származtatott termékek, Panem-Prentice Hall, 1999.	Prelegere, Metode interactive	2
2. Bazele managementului financiar al firmei. Procesul de management al riscului la nivelul firmei Bibliografie: Farkas Sz. – Szabó J.: Kockázati menedzsment. PMS 2000 Kft, 2003. Hull, J. C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb származtatott termékek, Panem-Prentice Hall, 1999.	Prelegere, Metode interactive	2
8.1.3 Cuantificarea riscului: abaterea medie pătratică, varianță, abaterea standard, semi-varianță, VaR, CVaR, ES Bibliografie: Farkas Sz. – Szabó J.: Kockázati menedzsment. PMS 2000 Kft, 2003. Hull, J. C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb származtatott termékek, Panem-Prentice Hall, 1999.	Prelegere, Metode interactive	2
8.1.4 Valoarea riscului. Valoarea expusă riscului Bibliografie: Farkas Sz. – Szabó J.: Kockázati menedzsment. PMS 2000 Kft, 2003. Hull, J. C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb származtatott termékek, Panem-Prentice Hall, 1999.	Prelegere, Metode interactive	2
8.1.5 Analiza riscului: modelare, analize de senzitivitate, analiza scenariu, simulare Bibliografie: Farkas Sz. – Szabó J.: Kockázati menedzsment. PMS 2000 Kft, 2003. Hull, J. C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb származtatott termékek, Panem-Prentice Hall, 1999.	Prelegere, Metode interactive	2

8.1.6 Riscurilor financiare și gestionarea acestora. Riscul financiar, acțiuni, obligațiuni, bursa de valori, piața OTC, piața OTC Bibliografie: Farkas Sz. – Szabó J.: Kockázati menedzsment. PMS 2000 Kft, 2003. Hull, J. C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb származtatott termékek, Panem-Prentice Hall, 1999.	Prelegere, Metode interactive	2
8.1.7 Bazele managementului portofoliilor. Managementul portofoliilor - averea și structura capitalului ui firmei. Noțiunea de portofoliu, diversificare Bibliografie: Farkas Sz. – Szabó J.: Kockázati menedzsment. PMS 2000 Kft, 2003. Hull, J. C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb származtatott termékek, Panem-Prentice Hall, 1999.	Prelegere, Metode interactive	2
8.1.8 Riscul de creditare și gestionarea acestuia. Evaluarea firmei, capital străin, capital propriu Bibliografie: Farkas Sz. – Szabó J.: Kockázati menedzsment. PMS 2000 Kft, 2003. Hull, J. C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb származtatott termékek, Panem-Prentice Hall, 1999.	Prelegere, Metode interactive	2
8.1.9 Caracteristicile tranzacțiilor cu derivate. Minimizarea riscului cu derivate. Operațiunile la termen. Operațiuni forward. Bibliografie: Farkas Sz. – Szabó J.: Kockázati menedzsment. PMS 2000 Kft, 2003. Hull, J. C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb származtatott termékek, Panem-Prentice Hall, 1999.	Prelegere, Metode interactive, Studii de caz	2
8.1.10 Principalele caracteristici ale operațiunilor futures. Poziția long, poziția short, preț de tranzacție, curs. Bibliografie: Farkas Sz. – Szabó J.: Kockázati menedzsment. PMS 2000 Kft, 2003. Hull, J. C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb származtatott termékek, Panem-Prentice Hall, 1999.	Prelegere, Metode interactive	2
8.1.11 Opțiuni. Opțiuni call, opțiuni put, prima de opțiune Bibliografie: Farkas Sz. – Szabó J.: Kockázati menedzsment. PMS 2000 Kft, 2003. Hull, J. C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb származtatott termékek, Panem-Prentice Hall, 1999.	Prelegere, Metode interactive	2
8.1.12 Operațiunile de hedging. Speculația, arbitrajul, hedge, operațiunile swap. Bibliografie: Farkas Sz. – Szabó J.: Kockázati menedzsment. PMS 2000 Kft, 2003. Hull, J. C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb származtatott termékek, Panem-Prentice Hall, 1999.	Prelegere, Metode interactive, Studii de caz	2

8.1.13 Opțiunile reale și utilizarea acestora. Investiții, managementul falimentului. Bibliografie: Farkas Sz. – Szabó J.: Kockázati menedzsment. PMS 2000 Kft, 2003. Hull, J. C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb zármaztatott termékek, Panem-Prentice Hall, 1999.	Prelegere, Metode interactive	2
8.1.14 Riscul valutar și posibilități gestionare a acestuia la nivelul firmei. Curs, export, import, operațiuni de hedging. Bibliografie: Farkas Sz. – Szabó J.: Kockázati menedzsment. PMS 2000 Kft, 2003. Hull, J. C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb	Prelegere, Metode interactive	2

8.2 Seminar	Metode de predare	Număr ore/Observații
8.2.1 Recapitularea facilităților oferite de aplicația Excel. Rezolvarea de probleme.	Dezbatare, Studiu de caz, Aplicații practice	2
8.2.2 Recapitularea facilităților oferite de programul Excel. Rezolvarea de probleme.	Dezbatare, Studiu de caz, Aplicații practice	2
8.2.3 Identificarea riscului. Discutarea studiilor de caz.	Dezbatare, Studiu de caz, Aplicații practice	2
8.2.4 Calcule de bază privind cuantificarea riscului în Excel. Posibilitățile de utilizare a sistemului statistic R în analiza riscului.	Dezbatare, Studiu de caz, Aplicații practice	2
8.2.5. Aplicații practice Var și Cvar în programul Excel și R statistics.	Dezbatare, Studiu de caz, Aplicații practice	2
8.2.6 Analize de sensibilitate și analize scenariu în programul Excel.	Dezbatare, Studiu de caz, Aplicații practice	2
8.2.7 Aplicații practice privind obligațiunile cu utilizarea programului Excel	Dezbatare, Studiu de caz, Aplicații practice	2
8.2.8 Posibilități de optimizare a portofoliilor în programul R statistics.	Dezbatare, Studiu de caz, Aplicații practice	2
8.2.9 Aplicații practice cu credite în programul Excel.	Dezbatare, Studiu de caz, Aplicații practice	2
8.2.10 Exemplificarea operațiunilor forward prin aplicații practice în programul Excel	Dezbatare, Studiu de caz, Aplicații practice	2
8.2.11 Exemplificarea operațiunilor futures prin aplicații practice în programul Excel	Dezbatare, Studiu de caz, Aplicații practice	2
8.2.12 Exemplificarea opțiunilor prin aplicații practice	Dezbatare, Studiu de caz, Aplicații practice	2

8.2.13 Exemplificarea operațiunilor de hedging prin aplicații practice	Dezbateri, Studiu de caz, Aplicații practice	2
8.2.14 Prezentarea calculelor cu opțiuni reale	Dezbateri, Studiu de caz, Aplicații practice	2

Bibliografie

1. Corelli A.: Understanding Financial Risk Management. Emerald Publishing. 2024. ISBN: 978-1-83753-250-6
2. Bodie, Z. – Kane, A. – Marcus, A.J.: Investments. McGraw Hill, 2023. ISBN 9781266085963
3. Hull, J.: Options, Futures, and Other Derivatives. Pearson, 2021. ISBN 9781292410654
4. Jankesgard, H. – Kapstad, P.: Empowered Enterprise Risk Management. John Wiley & Sons, Ltd. 2021. ISBN 9781119700180
5. Farkas, Sz. – Szabó, J.: A kockázatkezelés és biztosítás alapjai. Budapest – Győr, 2022.
<https://www.studocu.com/hu/document/budapest-business-university/szervezeti-es-humanmenedzsment/kockazatkzeles-es-biztositas-konyv/91133316>
6. Brigham, E.F. – Daves P.R.: Intermediate Financial Management. Cengage Learning Inc., 2019, ISBN: 978-1-337-39508-3
7. Consigli, G. – Kuhn, D. Brandimarte, P.: Optimal Financial Decision Making under Uncertainty. Springer Nature. 2017. ISBN 978-3-319-41613-7
8. Simozar, S.: The Advanced Fixed Income and Derivatives Management Guide. John Wiley & Sons Ltd, ISBN 978-1-119-01416-4
9. Farkas, Sz. – Szabó, J.: Vállalati kockázatkezelés kézikönyve. Dialog Campus, 2012. ISBN 978-963-729-631-4
10. Bélyácz, I.: Stratégiai beruházások és reálopciók. Aula Kiadó, Budapest, 2011. ISBN 239-995-665-488-6
11. Jorion, P.: Value at Risk: the new benchmark for managing financial risk. McGraw Hill Professional, 2011. ISBN 9780071736923
12. Damodaran, A.: A befektetések értékelése. Módszerek és eljárások. Panem Kiadó, 2010. ISBN 9789635454556
13. Merna, T. – Al-Thani, F.: Corporate Risk Management. John Wiley & Sons, LTD. 2008. ISBN 978-0-470-51833-5

9. Coroborarea conținuturilor disciplinei cu așteptările reprezentanților comunității epistemice, asociațiilor profesionale și angajatori reprezentativi din domeniul aferent programului

- Conținutul cursului Managementul riscului oferă viitorilor economiști competențe de utilizare corectă a terminologiilor din domeniul controlului și auditului financiar în limba maternă;
- Temele propuse de această disciplină contribuie la înțelegerea de către viitorii manageri a principalelor categorii de risc prezente în mediul înconjurător al firmei și a posibilităților de gestionare al acestora;
- Participând activ la cursul de Managementul riscului, viitorii economiști pot deprinde

abilități de fundamentare a deciziilor financiare în condiții de risc;

10. Evaluare

Tip activitate	10.1 Criterii de Evaluare	10.2 Metode de evaluare	10.3 Pondere din nota finală
10.5.1 Curs	Abordarea subiectelor teoretice	Examen oral	50%
10.5.2 Seminar	Rezolvarea de aplicații practice în programul Excel	Evaluare pe parcursul semestrului	50%
10.6 Standard minim de performanță - cunoașterea conținutului cursurilor la nivelul ideilor esențiale; - întocmirea proiectelor din tematica propusă; - participarea activă la studiile de caz și aplicațiile practice tratate la seminarii;			

Data completării

Semnătura titularului de curs

Semnătura titularului de seminar

16.09.2024

dr. Tibor Tarnóczy

dr. Edina Kulcsár

Data avizării în departament

Semnătura directorului de departament
Dr. Edit Veres

.....

.....