

# Fișa disciplinei

## 1. Date despre program

1.1. Instituția de învățământ	ACADEMIA DE STUDII ECONOMICE
1.2. Facultatea	RELAȚII ECONOMICE INTERNAȚIONALE
1.3. Departamente	(Departament) RELAȚII ECONOMICE INTERNAȚIONALE
1.4. Domeniul de studii	Economie și afaceri internaționale
1.5. Ciclul de studii	MASTERAT
1.6. Forma de învățământ	CU FRECVENȚĂ
1.7. Programul de studii	Managementul riscului financiar internațional
1.8. Limba de studiu	Română
1.9. Anul universitar	2022-2023

## 2. Date despre disciplina

2.1. Denumire	<b>Managementul riscului în afacerile internaționale</b>									
2.2. Cod	<b>22.0137IF1.1-0004</b>									
2.3. Anul de studii	<b>1</b>	2.4. Semestrul	<b>1</b>	2.5. Forma de evaluare	<b>Examen</b>	2.6. Regimul disciplinei	<b>O (Obligato riu)</b>	2.7. Nr. credite ECTS	<b>6</b>	
2.8. Titulari	C(C)	<b>conf.univ.dr. CONSTANTIN Laura Gabriela</b>					laura.constantin@rei.ase.ro			
	S(S)	<b>conf.univ.dr. CONSTANTIN Laura Gabriela</b>					laura.constantin@rei.ase.ro			

## 3. Timp total estimat

3.1. Număr de săptămâni	14.00
3.2. Număr de ore pe săptămână	3.00 din care
	S(S) 1.00
	C(C) 2.00
3.3. Total ore din planul de învățământ	42.00 din care
	S(S) 14.00
	C(C) 28.00
3.4. Total ore de studiu pe semestru (număr ECTS*25 ore)	150.00
3.5. Total ore studiu individual	108.00
<i>Distribuția fondului de timp pentru studiu individual</i>	
Studiu după manual, suport de curs, bibliografie și notițe	40.00
Documentare suplimentară în bibliotecă, pe platformele electronice de specialitate și pe teren	24.00
Pregătire seminarii, laboratoare, teme, referate, portofolii și eseuri	40.00
Tutoriat	2.00
Examinări	2.00
Alte activități	0.00

## 4. Precondiții

4.1. de curriculum	-
4.2. de competențe	-

### 5. Condiții desfășurare activități

pentru S(S)	• Seminariile se desfășoară în săli.
pentru C(C)	• Prelegerile se desfășoară în săli cu acces la internet și cu echipament de predare multimedia.

### 6. Competențe specifice acumulate

PROFESIONALE	C3	Modelarea fenomenelor economice și financiare
PROFESIONALE	C5	Managementul expunerii la risc prin analiza datelor și informațiilor despre sursele de risc financiar

### 7. Obiectivele disciplinei

7.1. Obiectivul general	Disciplina își propune să familiarizeze studenții cu principalele tipuri de riscuri în afacerile internaționale prin prezentarea unor metode de măsurare și gestiune a acestora.
7.2. Obiective specifice	Analiza principalelor tipuri de riscuri pentru corporațiile multinaționale. Măsurarea și gestiunea principalelor tipuri de riscuri pentru corporațiile multinaționale

### 8. Conținuturi

8.1. C(C)		Metode de predare/ lucru	Recomandări
1	Curs introductiv. Prezentarea generală a cursului (organizarea cursului, tematică, modalitate de notare, bibliografie etc.). Se vor prezenta aspecte privind importanța managementului riscului. Tema 1: Fundamentele managementului riscului. Teoria modernă a portofoliului, CAPM s.a.	Prelegerile sunt axate pe utilizarea de suport power-point și pe acces la resurse multimedia.	
2	Tema 2: Riscul de rată de dobândă. Se vor prezenta aspecte privind riscul de rată dobândă, precum și metode de măsurare și gestiune a acestuia.	Prelegerile sunt axate pe utilizarea de suport power-point și pe acces la resurse multimedia.	
3	Tema 3: Riscul valutar. Se vor prezenta aspecte privind riscul valutar, precum și metode de măsurare și gestiune a acestuia.	Prelegerile sunt axate pe utilizarea de suport power-point și pe acces la resurse multimedia.	
4	Tema 4: Riscul de piață. Se vor prezenta aspecte privind riscul de piață, precum și metode de măsurare a acestuia.	Prelegerile sunt axate pe utilizarea de suport power-point și pe acces la resurse multimedia.	
5	Tema 5: Riscul de lichiditate. Se vor prezenta aspecte privind riscul de lichiditate, precum și metode de măsurare și gestiune a acestuia.	Prelegerile sunt axate pe utilizarea de suport power-point și pe acces la resurse multimedia.	
6	Tema 6: Riscul de credit. Se vor prezenta aspecte privind riscul de credit, precum și metode de măsurare și gestiune a acestuia.	Prelegerile sunt axate pe utilizarea de suport power-point și pe acces la resurse multimedia.	
7	Tema 7: Riscul operațional. Se vor prezenta aspecte privind riscul operațional, precum și metode de măsurare și gestiune a acestuia.	Prelegerile sunt axate pe utilizarea de suport power-point și pe acces la resurse multimedia.	

### ***Bibliografie***

- Saunders, A.; Cornett, M.M, Financial institution management: a risk management approach, 9th Edition, , McGraw-Hill Education, New York, 2018
- Jorion, P, Financial risk manager handbook plus test bank : FRM Part I/Part II, John Wiley & Sons, New Jersey, 2011
- Jorion, P, Value at risk : the new benchmark for managing financial risk, McGraw-Hill, New York, 2001
- Hull, J. C., , Options, Futures and Other Derivatives, Pearson Education, New York, 2018
- Horobeț A., Managementul riscului în investițiile internaționale, All Beck, 2005
- Lupu, R., Managementul riscului cu produse financiare derivate, Editura Economica, 2008
- McDonald, R.L., Derivatives markets, 2nd Edition, Addison Wesley, Boston, 2006
- Bodie, Z., Kane, A., Marcus, A.J, Investments, Ed. 10, McGraw-Hill, Maidenhead, 2014
- Materialele prezentate și recomandate de la curs și seminar. The materials presented and recommended from the course and seminar
- Hurduzeu, Gheorghe, coord.; Nicolescu, Luminita, coord., Relatii economice internationale : teorii, strategii, politici, instrumente si studii de caz, Editura ASE, Bucuresti, 2017
- Constantin, L.G., Obligațiuni inovative pentru dezvoltare durabilă: finanțarea și managementul riscurilor de catastrofe naturale, climatice și sociale pe piețele financiare internaționale, Editura ASE, Bucuresti, 2017

8.2. S(S)		Metode de predare/ lucru	Recomandări
1	Seminar introductiv: Prezentarea structurii seminarului și a modalității de notare. Tema 1: Fundamentele managementului riscului	Prezentare Aplicații și/sau probleme	
2	Tema 2: Riscul de rată de dobândă	Aplicații și/sau probleme	
3	Tema 3: Riscul valutar	Aplicații și/sau probleme	
4	Tema 4: Riscul de piață	Aplicații și/sau probleme	
5	Tema 5: Riscul de lichiditate	Aplicații și/sau probleme	
6	Tema 6: Riscul de credit	Aplicații și/sau probleme	
7	Tema 7: Riscul operațional	Aplicații și/sau probleme	

### **Bibliografie**

- Saunders, A.; Cornett, M.M, Financial institution management: a risk management approach, 9th Edition, , McGraw Hill, 2018
- Jorion, P, Financial risk manager handbook plus test bank : FRM Part I/Part II, John Wiley & Sons, New Jersey, 2011
- Jorion, P, Value at risk : the new benchmark for managing financial risk, McGraw-Hill, New York, 2001
- Hull, J. C., , Options, Futures and Other Derivatives, Pearson Education, New York, 2018
- Horobeț A., Managementul riscului în investițiile internaționale, All Beck, 2005
- Lupu, R., Managementul riscului cu produse financiare derivate, Editura Economica, 2008
- McDonald, R.L., Derivatives markets, 2nd Edition, Addison Wesley, Boston, 2006
- Bodie, Z., Kane, A., Marcus, A.J, Investments, Ed. 10, McGraw-Hill, Maidenhead, 2014
- Materialele prezentate și recomandate de la curs și seminar. The materials presented and recommended from the course and seminar
- Hurduzeu, Gheorghe, coord.; Nicolescu, Luminita, coord., Relatii economice internationale : teorii, strategii, politici, instrumente si studii de caz, Editura ASE, Bucuresti, 2017
- Constantin, L.G., Obligațiuni inovative pentru dezvoltare durabilă: finanțarea și managementul riscurilor de catastrofe naturale, climatice și sociale pe piețele financiare internaționale, Editura ASE, Bucuresti, 2017

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

Discutarea conținutului disciplinei cu reprezentanți ai companiilor și cu alți colegi care predau această disciplină în cadrul universităților din România și din UE.

## **10. Evaluare**

Activitatea	Criterii de evaluare	Metode de evaluare	Pondere în nota finală
10.1. S(S)	Se evaluează maniera de expunere a problematicii abordate	Proiect de echipa	10.00
10.2. S(S)	Se evaluează corectitudinea răspunsurilor, argumentarea soluțiilor propuse și maniera de rezolvare a sarcinilor	Teme individuale	30.00
10.3. Evaluare finală	Se evaluează corectitudinea răspunsurilor, argumentarea soluțiilor propuse și maniera de rezolvare a sarcinilor	Examen scris	60.00
10.4. Modalitatea de notare	Note întregi 1-10		
10.5. Standard minim de performanță	Oferirea de răspunsuri corecte și justificate		

Data listării,

10/07/2026

Titulari,

Data avizării în departament,

Director departament,