

**УЧЕБНА ПРОГРАМА**

Утвърждавам:

Декан:

BA 404

**АНАЛИЗ И ОЦЕНКА НА РИСКА**

Приета: прот. № 15 от 23.06.2016 г.

Лектор: Акад. И.Попчев

**АНОТАЦИЯ**

Курсът по "Анализ и оценка на риска" разглежда основни понятия, подходи за изследване, класификации и тенденции за развитие на теорията на риска.

**ОСНОВНИ ЦЕЛИ**

Целите на курса са придобиване на знания в областта на анализа и оценката на риска, стандартите за управление на риска, етапи на процеса на управление на риска, измерване и източници на риска.

**ПРЕДПОСТАВКИ**

Необходимите предварителни знания за резултатното овладяване на знанията в този курс са: математически анализ, вероятности и статистика, електронни таблици, бази от данни.

**СТАТУТ И СТРУКТУРА**

специалност	статут	Кредити	редовн обучение				задочно обучение			
			л	с	у	общ	л	с	у	общ
Финанси	Избираема	6	45	15	-	60	30	-	-	30
Счетоводство и контрол	Избираема	6	45	15	-	60	30	-	-	30
Бизнес администрация	Избираема	6	45	15	-	60	30	-	-	30

**СЪДЪРЖАНИЕ НА КУРСА**

**Тема 1.** Феноменът риск: основни понятия и подходи за изследване Класификации и общи дефиниции.

**Тема 2.** Развитие на теорията на риска - исторически анализи и етапи. Нови направления на изследване.

**Тема 3.** Стандарти за управление на риска (ISO/IEC и NIST).

**Тема 4.** Измерване и източници на риска.

**Тема 5.** Субект и обект на управлението на риска. Основни групи функции. Операционен риск.

**Тема 6.** Задачи на управлението на риска. Режими Общ рисков спектър.

**Тема 7.** Етапи на процеса на управление на риска. Типична пететапна схема.

**Тема 8.** Вземане на финансови решения при неопределеност и риск. Основни математически модели.

**Тема 9.** Стратегии за управление на риска. Основни методи при трансфер на риска.

**Тема 10.** Основни черти на новата и старата парадигма на управлението на риска Интегрирано управление на риска на организацията

**Тема 11.** Диверсификация. Модел на Х.Марковиц Модел на Тобин.

**Тема 12.** Модел за оценка на капиталовите активи (CAPM).

**Тема 13.** Изчислителни модели за анализ и оценка на портфейлния риск при два и повече активи. Лагранжов модел.

**Тема 14.** Арбитражна теория на ценообразуване. Едно и много факторни модели.

**Тема 15.** Хеджиране. Същност, подходи и типове хеджиране.

**Тема 16.** Оптимално хеджиране. Гръцки букви. Неутрални хеджиращи стратегии.

**Тема 17.** Застраховане и презастраховане. Застрахователен риск. Критерии за класификация на риска.

**Тема 18.** Анализ и оценка на риска на информационните технологии.

## ПЛАНИРАНИ УЧЕБНИ ДЕЙНОСТИ И МЕТОДИ НА ОБУЧЕНИЕ

класически лекции, електронно обучение

## ПРЕПОРЪЧИТЕЛНА ЛИТЕРАТУРА

1. Георгиев, Р. Делови решения и сигурност на организацията. Издателство „Софт Трейд”, С., 2007.
2. Драганов, Х., Г. Димитров. Управление на риска. С., 2009.
3. Котлър, Ф., Д. А. Каслионе. Хаотика: Мениджмънт и маркетинг в епохата на турбулентността. „Локус пбблишинг” ЕООД, Печат: Абагар АД, С., 2009.
4. Лехтонен, Я. Рискове на публичността (превод от англ. език). Издателство „Рой Комюникейшън ЕООД”, С., 2006.
5. Мей, Д., К. Симънс. Всеки бизнес се нуждае от един „ангел”: Как да получите необходимите средства за растежа на своя бизнес. Издателство „Класика и стил” ООД, С., 2008.
6. Менгов, Г. Вземане на решения при риск и неопределеност. Издателска къща „Жанет-45”, С., 2010.
7. Орешарски, П. Инвестиции: Анализ и управление на инвестиционни портфейли. „ЕА” АД, Плевен, 2009.
8. Петранов, С. Инвестиции. Издателство „Класика и стил”, С., 2010.
9. Попчев, И. Многокритериален избор на проектни решения: Някои практически алгоритми. В: „Финансови решения: Изследвания и практики”. Издателство на Нов български университет, С., 2009.
10. Попчев, И. Рискът в новата парадигма. В: Мениджмънт и лидерство (под редакцията на доц. д-р Димитър Панайотов). Издателство на Нов български университет, 2016, София, 95-118. ISBN: 978-954-535-499-1.
11. Попчев, И. Турбулентност, решения и афоризми. В: „Списание на Българската академия на науките”, СХХIII, бр. 6, 2010, 85-89.

12. Попчев, И. Шест теми по управление на риска. ЛКНТ No. 1, ИИКТ – БАН, 2016, eISSN: 2367-8666, eISBN: 978-954-91700-8-5, 73 стр.
13. Попчев, И. Стратегическа визия: Студентите в реалността. В: Научно-практическа конференция “Стратегически визии: ефективно управление за икономически, Организационни и социални трансформации (Иновации – Институции – Бизнес)”, Нов Български университет. 49-59, София, 2016, ISBN: 978-954-535-949-1.
14. Попчев, И. Реалният свят да се върне обратно в класната стая. В: Юбилейна научна конференция с международно участие “Новата идея в образованието”, Бургаски свободен университет, фонд “Научни изследвания – Министерство на образованието и науката”, Том I, 11-32. (Том II, 11-32), Бургас, 2016. ISBN 978-619-7126-28-0.
15. Стиглиц, Д. Свободно падане. Америка, свободните пазари, кризата и виновните за нея. Издателска къща „ИнфоДар”, С., 2010.
16. Талеб, Н. Н. Надхитрени от случайността: Скритата роля на случайността в живота и на пазара. Издателска къща „ИнфоДар” ЕООД, С., 2009.
17. Талеб, Н. Н. Черният лебед: Въздействие на слабо вероятното в живота и на пазара. Издателска къща „ИнфоДар” ЕООД, С., 2009.
18. Уолш, К. Ключовите коефициенти в мениджмънта: Най-достъпният гид във важните за вашия бизнес цифрови показатели (четвърто издание). Издателска къща „ИнфоДар” ЕООД, С., 2008.
19. Христов, П. Метатеория на риска. Парадигми и подходи. Издателство „Албатрос”, С., 2010.
20. Цончев, Р. Финансови изчисления. Издателство на Нов български университет, С., 2009.
21. Konabar, V., R. D, Warburton. MBA Fundamentals: Project Management. Kaplan Publishing, New York, 2008.



## УЧЕБНА ПРОГРАМА

ВА 404

### АНАЛИЗ И ОЦЕНКА НА РИСКА

Лектор: Акад. И.Попчев

**Тема 1.** Феноменът риск: основни понятия и подходи за изследване Класификации и общи дефиниции.

**Тема 2.** Развитие на теорията на риска - исторически анализи и етапи. Нови направления на изследване.

**Тема 3.** Стандарти за управление на риска (ISO/IEC и NIST).

**Тема 4.** Измерване и източници на риска.

**Тема 5.** Субект и обект на управлението на риска. Основни групи функции. Операционен риск.

**Тема 6.** Задачи на управлението на риска. Режими Общ рисков спектър.

**Тема 7.** Етапи на процеса на управление на риска. Типична пететапна схема.

**Тема 8.** Вземане на финансови решения при неопределеност и риск. Основни математически модели.

**Тема 9.** Стратегии за управление на риска. Основни методи при трансфер на риска.

**Тема 10.** Основни черти на новата и старата парадигма на управлението на риска Интегрирано управление на риска на организацията

**Тема 11.** Диверсификация. Модел на Х.Марковиц Модел на Тобин.

**Тема 12.** Модел за оценка на капиталовите активи (CAPM).

**Тема 13.** Изчислителни модели за анализ и оценка на портфейлния риск при два и повече активи. Лагранжов модел.

**Тема 14.** Арбитражна теория на ценообразуване. Едно и много факторни модели.

**Тема 15.** Хеджиране. Същност, подходи и типове хеджиране.

**Тема 16.** Оптимално хеджиране. Гръцки букви. Неутрални хеджиращи стратегии.

**Тема 17.** Застраховане и презастраховане. Застрахователен риск. Критерии за класификация на риска.

**Тема 18.** Анализ и оценка на риска на информационните технологии.

### ПРЕПОРЪЧИТЕЛНА ЛИТЕРАТУРА

1. Георгиев, Р. Делови решения и сигурност на организацията. Издателство „Софт Трейд“, С., 2007.
2. Драганов, Х., Г. Димитров. Управление на риска. С., 2009.
3. Котлър, Ф., Д. А. Каслионе. Хаотика: Мениджмънт и маркетинг в епохата на турбулентността. „Локус пबблишинг“ ЕООД, Печат: Абагар АД, С., 2009.
4. Лехтонен, Я. Рискове на публичността (превод от англ. език). Издателство „Рой

- Комюникейшън ЕООД”, С., 2006.
5. Мей, Д., К. Симънс. Всеки бизнес се нуждае от един „ангел”: Как да получите необходимите средства за растежа на своя бизнес. Издателство „Класика и стил” ООД, С., 2008.
  6. Менгов, Г. Вземане на решения при риск и неопределеност. Издателска къща „Жанет-45”, С., 2010.
  7. Орешарски, П. Инвестиции: Анализ и управление на инвестиционни портфейли. „ЕА” АД, Плевен, 2009.
  8. Петранов, С. Инвестиции. Издателство „Класика и стил”, С., 2010.
  9. Попчев, И. Многокритериален избор на проектни решения: Някои практически алгоритми. В: „Финансови решения: Изследвания и практики”. Издателство на Нов български университет, С., 2009.
  10. Попчев, И. Рискът в новата парадигма. В: Мениджмънт и лидерство (под редакцията на доц. д-р Димитър Панайотов). Издателство на Нов български университет, 2016, София, 95-118. ISBN: 978-954-535-499-1.
  11. Попчев, И. Турбулентност, решения и афоризми. В: „Списание на Българската академия на науките”, СХХIII, бр. 6, 2010, 85-89.
  12. Попчев, И. Шест теми по управление на риска. ЛКНТ No. 1, ИИКТ – БАН, 2016, eISSN: 2367-8666, eISBN: 978-954-91700-8-5, 73 стр.
  13. Попчев, И. Стратегическа визия: Студентите в реалността. В: Научно-практическа конференция “Стратегически визии: ефективно управление за икономически, Организационни и социални трансформации (Иновации – Институции – Бизнес)”, Нов Български университет. 49-59, София, 2016, ISBN: 978-954-535-949-1.
  14. Попчев, И. Реалният свят да се върне обратно в класната стая. В: Юбилейна научна конференция с международно участие “Новата идея в образованието”, Бургаски свободен университет, фонд “Научни изследвания – Министерство на образованието и науката”, Том I, 11-32. (Том II, 11-32), Бургас, 2016. ISBN 978-619-7126-28-0.
  15. Стиглиц, Д. Свободно падане. Америка, свободните пазари, кризата и виновните за нея. Издателска къща „ИнфоДар”, С., 2010.
  16. Талеб, Н. Н. Надхитрени от случайността: Скритата роля на случайността в живота и на пазара. Издателска къща „ИнфоДар” ЕООД, С., 2009.
  17. Талеб, Н. Н. Черният лебед: Въздействие на слабо вероятното в живота и на пазара. Издателска къща „ИнфоДар” ЕООД, С., 2009.
  18. Уолш, К. Ключовите коефициенти в мениджмънта: Най-достъпният гид във важните за вашия бизнес цифрови показатели (четвърто издание). Издателска къща „ИнфоДар” ЕООД, С., 2008.
  19. Христов, П. Метатеория на риска. Парадигми и подходи. Издателство „Албатрос”, С., 2010.
  20. Цончев, Р. Финансови изчисления. Издателство на Нов български университет, С., 2009.
  21. Konabar, V., R. D, Warburton. MBA Fundamentals: Project Management. Kaplan Publishing, New York, 2008.