

ИКОНОМИЧЕСКИ УНИВЕРСИТЕТ - ВАРНА
ФАКУЛТЕТ "УПРАВЛЕНИЕ"
КАТЕДРА "УПРАВЛЕНИЕ И АДМИНИСТРАЦИЯ"

УТВЪРЖДАВАМ:

(проф. д-р Пл. Илиев)

У Ч Е Б Н А П Р О Г Р А М А

ПО ДИСЦИПЛИНАТА: УПРАВЛЕНИЕ НА РИСКА;

ЗА СПЕЦ: Мениджмънт; ОКС „бакалавър“

КУРС НА ОБУЧЕНИЕ: 4; СЕМЕСТЪР: 8;

ОБЩА СТУДЕНТСКА ЗАЕТОСТ: 150 ч., в т.ч. аудиторна 60 ч.

КРЕДИТИ: 5

РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ НА СТУДЕНТСКАТА ЗАЕТОСТ СЪГЛАСНО УЧЕБНИЯ ПЛАН

<i>ВИД УЧЕБНИ ЗАНЯТИЯ</i>	<i>ОБЩО(часове)</i>	<i>СЕДМИЧНА НАТОВАРЕНОСТ (часове)</i>
АУДИТОРНА ЗАЕТОСТ:		
Т. ч.		
• ЛЕКЦИИ	30	2
• УПРАЖНЕНИЯ (семинарни занятия/ лабораторни упражнения)	30	2
		-
ИЗВЪНАУДИТОРНА ЗАЕТОСТ	90	

Изготвили програмата:

1.
(доц. д-р Д. Добрев)

2.
(доц. д-р Р. Николаев)

3.....
(ас. М. Владимиров)

Ръководител катедра:
"Управление и администрация" (доц. д-р Д. Добрев)

I. АНОТАЦИЯ

В първата си част този курс разглежда поотделно всички значими производни финансови инструменти: договорите за курса по форуърд, комбинираното споразумение а форуърден обмен, фючърси, суапове и опции. Втората част на курса демонстрира начините за употреба на различните средства- поотделно и в комбинация за да се структурира и управлява риска при лихвените проценти, валутните курсове и т.н. Студентите получават практически знания и умения по управление на риска.

II. ТЕМАТИЧНО СЪДЪРЖАНИЕ

No. по ред	НАИМЕНОВАНИЕ НА ТЕМИТЕ И ПОДТЕМИТЕ	БРОЙ ЧАСОВЕ		
		Л	СУ	ЛУ
ТЕМА 1. Основи на управлението на риска		3	2	
1.1	Количествен анализ	1	1	
1.2	Моделиране.	2	1	
ТЕМА 2. Финансови пазари и продукти.		3	2	
2.1	Капиталов пазар	1	1	
2.2	Дългов пазар	2	1	
ТЕМА 3. Финансови фючърси		3	2	
3.1.Краткосрочни лихвени фючърси		1	1	
3.2.Фючърси върху облигации и борсови индекси		2	1	
ТЕМА 4. Форуърдни курсове Комбиниран договор за форуърден обмен		3	2	
4.1	Определение, терминология и процес на изпълнение	1	1	
4.2	Оценяване	2	1	
ТЕМА 5. Суап		3	2	
5.1	Определение на лихвен суап и суап в кръстосана валута	1	1	
5.2	Оценяване.	2	1	
ТЕМА 6. Опции		3	2	
6.1	Същност, видове	1	1	
6.2	Оценяване.	2	1	
ТЕМА 7. Управление на финансовия риск		3	2	
7.1	Съпоставка между хеджингови стратегии	1	1	
7.2.	Основни форми на опционен хеджинг	2	1	
ТЕМА 8. Управление на лихвения риск		3	2	
8.1	Употреба на краткосрочни лихвени фючърси	1	1	
8.2	Управление на рисковата конвергенционна база	2	1	

ТЕМА 9. Управление на фондовия риск.		3	2	
9.1	Стратегия за защита на стойността	1	1	
9.2	Вертикален, хоризонтален и диагонален спред	2	1	
ТЕМА 10. Управление на кредитния риск		3	2	
10.1	Въведение в кредитния риск	1	1	
10.2	Кредитни деривати.	2	1	
Общо:		30	30	

III. ФОРМИ НА КОНТРОЛ:

№. по ред	ВИД И ФОРМА НА КОНТРОЛА	БРОЙ	И.А.З. Ч.
1.	Текущ контрол		
1.1.	Тест	2	90
Общо за семестриален контрол:		2	90
2.	Сесиен (краен) контрол		
2.1.	Изпит (тест)	1	60
Общо за сесиен контрол:		1	60
ОБЩО:		3	150

V. ЗАДЪЛЖИТЕЛНА ЛИТЕРАТУРА:

1. The World's First Stock Exchange -Columbia Business School Publishing- Hardcover - 2014 Lo Dewijk Petram
2. Stock Market Investing for Beginners: Essentials to Start Investing Successfully- Tycho Press Berkeley California -2013
3. Fundamentals of Financial Instruments: An Introduction to Stocks, Bonds, Foreign Exchange, and Derivatives -Sunil K. Parameswaran ISBN: 978-0-470-82490-0; John Wiley & Sons inc- 2011
- 4.

ПРЕПОРЪЧИТЕЛНА ЛИТЕРАТУРА:

5. Fundamentals of Investment Management (McGraw-Hill/Irwin series in finance, insurance, and Real Estate-2014) ISBN-10: 0078034620 Geoffrey Hirt , Stanley Block
6. The Theory and Practice of Investment Management: Asset Allocation, Valuation, Portfolio Construction, and Strategies Hardcover – April 5, 2011 Frank J. Fabozzi , Harry M. Markowitz
7. Introduction to Finance: Markets, Investments, and Financial Management 15th Edition ISBN-10: 1118492676 Ronald W. Melicher 2014 John Wiley & Sons inc
8. Modern Portfolio Theory and Investment Analysis Edwin J. Elton Stephen J. Brown ISBN-10: 1118469941 John Wiley & Sons inc 2014