



## Конспект

1. Въведение в теорията за понятието риск. Неопределеност на риска. Мерки за оценка на риска.
2. Едноетапни процедури при вземане на решения в условия на неопределеност. Критерии на Лаплас, Гурвиш, минимален критерий.
3. Основни етапи при разработване на инвестиционен проект (ИП).
4. Показатели за ефективност на ИП.
5. Статистически методи за изчисляване на рисковата премия.
6. Анализ и проектиране на имитационното моделиране на инвестиционния риск.
7. Класификация на рисковете.
8. Механизми на лимитиране на концентрацията на финансовите рискове.
9. Основни концепции при управление на риска.
10. Софтуерни продукти за анализ в теорията на риска.
11. Инвестиционни портфейли.
12. Методи за оценка на вероятността на неблагоприятните събития.
13. Модел за оценка на фондовите активи.
14. Добри практики при разработване на системи за анализ на риска.

## Препоръчителна литература

1. Dixit, A. K. and R. Pindyck. 1995. The Options Approach, to Capital Investment. Harvard Business Review, Vol. 77
2. A.C. Shapkin, Risk Theory and Modeling of Risk Situations (M: Dashkov and K) 2005
3. A. G. Sholominski, Risk Theory. Uncertainty selection and risk modeling (A publishing
4. Pavlov V., E. Raeva, (2015) *On The Risk Modeling In General Insurance*, Economy & Business Journal 9 (1), 563-574
5. Алехин Е. И. (2006) Теория на риска и моделиране на рискови ситуации“ Курс лекции Орловски Държавен университет.