



ИДЕЕН ПРОЕКТ ЗА ДИСЕРТАЦИЯ

**в професионално направление 4.5 „Математика”, специалност
„Математическо моделиране и приложение на математиката“**

Евентуален ръководител: доц. д-р Илияна Раева

1. Проблем:

Анализ и изследване на риска при оценяване на инвестиционни проекти в областта на икономиката и финансите. Изследване на различните критерии за оценка на риска и възможностите за прилагането им в реални бизнес условия в България. Използване на известни програмни продукти за моделиране на рискови ситуации.

2. Тема на дисертацията: „Изследване на методите за анализ на риска при разработване на инвестиционни проекти.”

3. Анотация

Понятието риск в областта на икономиката и финансите е ключово за тяхното развитие. Рискът се разглежда в два аспекта: положителен и отрицателен. При общата употреба на думата *risk* вниманието се фокусира само върху потенциалната вреда (загуба на позитивни резултати или средства), която може да възникне от бъдещо събитие. Негативните последици от риска, обуславят необходимостта от неговото изучаване и управление.

За анализа и оценката на риска е необходимо задълбочено познаване на най-често използваните и доказани в практиката едноетапни критерии за вземане на решения в условията на неопределеност.

Целта е да се изследват различни подходи и модели за анализ, като се направи изследване за тяхната ефективност и възможностите за прилагането им при реални инвестиционни проекти.

Основополагащ принцип на оценка на икономическата ефективност на даден инвестиционен проект е да съответства на икономическото поведение на човека при вземане на решение за целесъобразността на едни или загубата на други инвестиции. Те се изразяват чрез показателя на



7017 Русе, ул. "Студентска" №8

<http://www.uni-ruse.bg>; secretary@uni-ruse.bg; тел.: 082-888 211; факс: 082-845 708

чистия доход. При изчисляване на чистия доход винаги се съизмерват резултатите и загубите.

Като резултат ще бъде направен модел на анализ на риска в реален инвестиционен проект.

Задачите, които трябва да се реализират са:

- Анализ на методите за оценка на риска;
- Анализ на данни, за прогнозен модел за оценяване на етапите при разработване на инвестиционен проект.
- Оценяване на най-често срещаните едноетапни критерии и методи за вземане на решения при неопределеност на риска.
- Създаване на модели за оценка на реален проект и изследване за ефективност.

Вид на докторантурата: редовна

Изготвил идейния проект:.....
(доц. д-р Илияна Раева)

