

ИМИ 1.1.

Тема: 1.1.28. СТОХАСТИЧНИ МЕТОДИ ЗА УПРАВЛЕНИЕ НА ПАЗАРНИЯ РИСК

STOCHASTIC METHODS FOR MARKET RISK MANAGEMENT

Лектор: доц. д-р Цветелин Заевски

Assoc. Prof. PhD Tsvetelin Zaevski

E-mail: t_s_zaeovski@math.bas.bg

Тел.: 02/ 979 38 46

Хорариум: 30 часа лекции

Анотация:

Курсът има за цел да задълбочи познанията на докторантите в областта на управлението на пазарния риск. Основна тема е рисковата мярка и нейните свойства. Материалът обхваща също изчисляване на рисковите мярки чрез отделни методи. Модерните мярки се сравняват, за да бъде изведена мярка с приемлив набор от свойства.

Abstract:

The course aims to enlarge the knowledge of the PhD students in the field of risk management. The main topic is the risk measure and its properties. The conspectus also covers deriving of risk measures using different methods. The measures used in the contemporary markets are compared in order to derive a measure with an acceptable set of properties.

Необходими предварителни знания:

Начални познания по теория на вероятностите, математическа статистика.

Required prior knowledge:

Basic knowledge on the probability theory, mathematical statistics, and stochastic processes

Компетентности, придобити в резултат на обучението:

Курсът дава подготовка по оценяване и управление на финансовия риск

Competencies acquired as a result of the course:

The course provides a knowledge on risk management.