

ПЛОВДИВСКИ УНИВЕРСИТЕТ "ПАИСИЙ ХИЛЕНДАРСКИ"
ФАКУЛТЕТ ПО ИКОНОМИЧЕСКИ И СОЦИАЛНИ НАУКИ

КОНСПЕКТ

ЗА ДЪРЖАВЕН ИЗПИТ ЗА ПРИДОБИВАНЕ

НА ОКС „МАГИСТЪР"

СПЕЦИАЛНОСТ „ФИНАНСОВ МЕНИДЖМЪНТ"

СПЕЦИАЛНОСТ „ФИНАНСИ"

1. Вземане на решения при риск. Оценка и управление на портфейлния риск.
2. Елементи на теорията на портфейла. Класиране на инвестиционни проекти с риск.
3. Теоретични основи на финансовия анализ. Същност на финансите и финансовото управление на фирмата. Видове финансов анализ и методи за анализ.
4. Годишни финансови отчети. Публикация, интерес и особености в представянето на финансовите отчети.
5. Финансова и капиталова структура. Финансов ливъридж (лост). Определяне на капиталовата структура.
6. Анализ на финансовите коефициенти.
7. Борсови финансови съотношения и модели за прогнозиране на финансови затруднения.
8. Методика на анализа на паричните потоци.
9. Обръщаемост на оборотния капитал и управление на материалните запаси.
10. Политики за управление на оборотния капитал.
11. Управление на наличните пари. Модели за намиране на оптималния паричен баланс. Оптимизиране на наличните пари.
12. Финансови инструменти с фиксиран доход и криви на доходността. Модел на Ниелсен-Сиегел-Свенсон. Дюрация, модифицирана дюрация. Особености при управлението на портфейл от облигации.
13. Стационарни времеви редове и клъстеризация на волатилността на финансовите пазари. Проверка за отклонения спрямо нормално раз-пределение. Трансформация на Бокс-Кокс.
14. Случайни процеси с връщане към средната стойност. Процес на Ornstein-Uhlenbeck. Моделиране на движението на лихвените проценти – модели на Vasicek и Cox-Ingersoll-Ross.
15. Характеристики и приложение на финансовите опции. Реални опции. BOPM и аналитични подходи за оценка на финансови опции. Приложение на Монте Карло симулации за оценка на опции.
16. Финансово посредничество в международните финанси – същност, роля и значение.

17. Основни форми на международни разплащания – етапи, предимства, недостатъци и видове рискове в международните търговски сделки.
18. Международни финансови трансфери и световни финансови центрове – системи, специфика, предимства.
19. Същност цели и задачи на бюджетния процес в предприятията. Основни функции на бюджета и отговорности за съставянето му. Бюджетен период. Основни етапи на бюджетния процес. Видове бюджети.
20. Технология на изготвянето на главен финансов бюджет и спомагателни бюджети.

Литература:

1. Попчев, И. Стратегии за управление на риска. – Записки на лектора. Нов български университет. С., 2004, 68. (http://is.iinf.bas.bg/staff_bg.html)
2. Попчев, И. Рискът в Новата парадигма. - Мениджмънт и лидерство (под редакцията на доц. д-р Д. Панайотов), Издателство на Нов български университет, 2008, София, 115-135, ISBN: 978-954-535-499-1.
3. Попчев, И., М. Петкова, С. Златев. Елементи от анализа и управлението на портфейлния риск. Практическо ръководство. ЛКНТ N:7, ИИКТ-БАН, 2017, EISSN: 2367-8666, EISBN: 978-619-7320-04-6, 30 стр.
4. 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.
5. Адамов, В. Холс Дж., Захариев А. Финансов анализ. В. Търново, АБАГАР, 1997.
6. Атанасов, Н., „Финанси на предприятието“, Пловдив, 2009, с.206
7. Ваньо Консулов, "Финансов анализ. Управление на оборотния капитал. С, 2018
8. Николова, Н., Корпоративни финанси. С., 2007
9. Боб Вос, Корпоративен анализ., С. 2006
10. Зви Боди, Алекс Кейн, Алън Маркър, "Инвестиции. София, 2000
11. Иванов И., Танов В., Алгоритми за анализ на големи данни и приложения, Авангард Прима: София, 2018, ISBN 978-619-239-010-5
12. Магнус Я. Р., Катъишев П. К., Пересецкий А. А., Эконометрика, Москва: Де-ло, 2000, ISBN 5-7749-0055-X
13. Кабаиванов, С., Иконометрия за финансиста, Издателство „Евдемония Про-дъкшън“-София, 2014, ISBN 978-954-92924-6-6
14. Цанков Т., Финансов инженеринг, Сиела, 2005, С., ISBN 9546497878
15. Brooks C., Introductory Econometrics for Finance, Cambridge University Press, 2008, ISBN 978-0-511-39848-3

16. Damodaran A., "Investment valuation", Wiley Finance, 2012, http://people.stern.nyu.edu/adamodar/New_Home_Page/Inv3ed.htm
17. Fabozzi F. (ed.), "Encyclopedia of Financial models", Vol I-III, Wiley, 2013, ISBN 978-1-118-00673-3
18. Fusai G., Roncoroni A., "Implementing models in quantitative finance: Methods and cases", Springer, Berlin, 2008

Нормативни актове

1. Закон за БНБ.
2. Закон за дружествата със специална инвестиционна цел.
3. Закон за ипотечните облигации.
4. Закон за комисията за финансов надзор.
5. Закон за кредитните институции.
6. Закон срещу пазарните злоупотреби с финансови инструменти.
7. Закон за потребителския кредит.
8. Закон за предоставяне на финансови услуги от разстояние.
9. Закон за публичното предлагане на ценни книжа.
10. Закон за корпоративното подоходно облагане
11. Закон за счетоводството.
12. Закон за финансовото управление и контрол в публичния сектор.

Конспектът е приет с решение на КС на катедра „Финанси и счетоводство“ (протокол № 54/18.02.2019 г.) и утвърден от ФС на Факултета по икономически и социални науки (протокол № 131/18.02.2019 г.).