

Алиев А. Т.

Управление инвестиционным портфелем: Учебное пособие
/ А. Т. Алиев, К. В. Сомик. — М.: Издательско- торговая
корпорация «Дашков и К°», 2012. — 160 с.

Содержание

ВВЕДЕНИЕ

Глава 1. ИНВЕСТИЦИОННЫЙ ПОРТФЕЛЬ

- 1.1. Понятие и сущность
- 1.2. Инвестиционные характеристики портфельных активов
 - 1.2.1. Акции
 - 1.2.2. Облигации
- 1.3. Классификация портфелей
- 1.4. Процесс управления

Глава 2. СОВРЕМЕННАЯ ТЕОРИЯ ПОРТФЕЛЯ

- 2.1. Основные гипотезы
 - 2.1.1. Гипотеза эффективности рынка
 - 2.1.2. Оценка инвестиционных решений
- 2.2. Модель Марковица
 - 2.2.1. Ожидаемая доходность акции
 - 2.2.2. Ожидаемый риск акций
 - 2.2.3. Ожидаемая доходность портфеля акций
 - 2.2.4. Ожидаемый риск портфеля акций
 - 2.2.5. Эффективная граница портфелей
 - 2.2.6. Оптимальный портфель
- 2.3. Модель Шарпа

Глава 3. СТРАТЕГИИ УПРАВЛЕНИЯ

- 3.1. Активные стратегии
- 3.2. Пассивные стратегии
- 3.3. Оценка эффективности

Приложение 1. Московская межбанковская валютная биржа (ММВБ) и торговая система **Quick**

Приложение 2. Основные финансовые вычисления

Приложение 3. Государственные облигации, векселя и банковские сертификаты ГКО

Приложение 4. Инструменты фундаментального анализа ценных бумаг

Приложение 5. Инструменты технического анализа ценных бумаг