

Новиков, А. В.

Финансовые инструменты : учеб. пособие / А. В. Новиков, Е. Е. Алексеев, П. А. Новгородов ; Новосиб. гос. ун-т экономики и управления. — Новосибирск : НГУЭУ, 2017. — 170 с.

Оглавление

ПРЕДИСЛОВИЕ.....	4
ВВЕДЕНИЕ.....	6
Глава 1. ФИНАНСОВЫЙ РЫНОК И ЕГО СЕГМЕНТЫ	
1.1. Трансформация сбережений в инвестиции.....	8
1.2. Финансовый рынок как институциональная структура.....	11
1.3. Понятие, цель и функции рынка ценных бумаг и рынка финансовых деривативов....	14
1.4. Финансовые инструменты рынка ценных бумаг и рынка финансовых деривативов....	16
1.5. Участники финансового рынка.....	22
Глава 2. ДОЛЕВЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ	
2.1. Назначение долевых ценных бумаг.....	39
2.2. Понятие и классификация акций.....	40
2.3. Инвестиционная привлекательность акций.....	43
2.4. Анализ дивидендной доходности акций.....	45
2.5. Оценка стоимости акций.....	48
2.6. Индексы цен на акции.....	56
2.7. Оценка риска инвестирования в акции.....	59
Глава 3. ДОЛГОВЫЕ ЦЕННЫЕ БУМАГИ	
3.1. Трансформация долговых обязательств в долговые ценные бумаги.....	65
3.2. Понятие и классификация облигаций.....	66
3.3. Анализ облигаций.....	70
3.4. Рейтинги облигаций.....	80
3.5. Корпоративные долговые ценные бумаги.....	82
3.6. Государственные долговые ценные бумаги.....	88
Глава 4. ПРОИЗВОДНЫЕ ФИНАНСОВЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ	
4.1. Сущность и виды деривативов.....	97
4.2. Срочные контракты и их классификация.....	98
4.3. Участники рынка срочных контактов.....	99
4.4. Форвардные и фьючерсные контракты.....	101
4.5. Опционы: понятие, классификация, использование.....	105
4.6. Свопы.....	111
Глава 5. ПОРТФЕЛЬ ФИНАНСОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ	
5.1. Риск и доходность.....	117
5.2. Современная портфельная теория.....	122
5.3. Модели САРМ и АРМ.....	126
5.4. Гипотеза эффективности рынка.....	134
Глава 6. АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ	
6.1. Макроэкономический и отраслевой фундаментальный анализ.....	144
6.2. Микроэкономический фундаментальный анализ.....	149
6.3. Технический анализ.....	153
ОТВЕТЫ НА ЗАДАНИЯ.....	164