

Аскинадзи, В. М.

Инвестиционный анализ. Практикум : учеб. пособие для академического бакалавриата / В. М. Аскинадзи, В. Ф. Максимова. — М. : Издательство Юрайт, 2018. — 399 с. — Серия : Бакалавр. Академический курс.

# Оглавление

<b>Предисловие.....</b>	<b>5</b>
<b>Глава 1. Инвестиции и инвестиционная деятельность ....</b>	<b>9</b>
1.1. Основные положения инвестиционного процесса.....	10
1.2. Классификация инвестиций.....	16
1.3. Факторы, воздействующие на инвестиционную деятельность.....	20
1.4. Оценка доходности и риска инвестиций.....	24
1.5. Государственное регулирование инвестиционной деятельности.....	39
<b>Глава 2. Инвестиционная деятельность в форме капитальных вложений.....</b>	<b>45</b>
2.1. Понятие капитальных вложений, субъекты и объекты капитальных вложений.....	46
2.2. Инвестиционный проект: сущность, классификация, жизненный цикл, особенности финансирования.....	51
2.3. Эффективность инвестиционного проекта и методы ее оценки.....	62
2.4. Оценка эффективности ИП с использованием <i>NPV</i> .....	74
2.5. Альтернативные способы оценки эффективности ИП.....	91
2.6. Риски инвестиционных проектов.....	98
<b>Глава 3. Инвестиционный портфель акций и его оптимизация.....</b>	<b>106</b>
3.1. Инвестиционный портфель и портфельное инвестирование.....	107
3.2. Модель Г. Марковица.....	114
3.3. Модель У. Шарпа.....	139
3.4. Модель <i>CAPM</i> и ее использование в портфельном анализе.....	150

<b>Глава 4. Управление портфелем облигаций.....</b>	<b>166</b>
4.1. Сущность и основные свойства облигаций.....	167
4.2. Особенности инвестирования в облигации.....	173
4.3. Доходность облигации: виды, факторы влияния.....	184
4.4. Волатильность и дюрация облигаций.....	193
4.5. Формирование портфеля облигаций и управление им.....	204
<b>Глава 5. Оценка результатов инвестиционной деятельности.....</b>	<b>217</b>
5.1. Определение доходностей реализованных инвестиций...	218
5.2. Оценка результатов инвестиционной деятельности с учетом соотношения доходности и риска.....	226
<b>Тесты и задачи.....</b>	<b>229</b>
<b>Глава 6. Инвестиционные возможности с использованием производных финансовых инструментов. ....</b>	<b>234</b>
6.1. Сущность и основные виды производных финансовых инструментов.....	235
6.2. Ценообразование опционов.....	241
6.3. Биномиальная модель ценообразования опционов.....	257
6.4. Инвестиционные возможности с использованием опционов.....	265
6.5. Инвестиционные возможности с использованием фьючерсов.....	273
<b>Глава 7. Инвестирование в нефинансовые инструменты.....</b>	<b>284</b>
7.1. Инвестирование в предметы антиквариата.....	285
7.2. Инвестирование в старинные монеты.....	310
7.3. Инвестирование в коллекционные вина.....	316
7.4. Инвестирование в драгоценные камни.....	326
<b>Ответы и решения.....</b>	<b>339</b>
<b>Литература.....</b>	<b>397</b>