

СПИСОК ОСНОВНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ

1. Буренин А.Н. Дюрация и кривизна в управлении портфелем облигаций. – М., Научно-техническое общество имени академика С.И.Вавилова, 2009.
2. Буренин А.Н. Рынок ценных бумаг и производных инструментов. – М., ООО «НТО», 2011.
3. Буренин А.Н. Хеджирование фьючерсными контрактами Фондовой биржи РТС. – М., Научно-техническое общество имени академика С.И.Вавилова, 2009.
4. Буренин А.Н. Управление портфелем ценных бумаг. – М., Научно-техническое общество имени академика С.И.Вавилова, 2008.
5. Буренин А.Н. Форварды, фьючерсы, опционы, экзотические и погодные производные. – М., ООО «НТО», 2011.
6. Математическая статистика. Под ред. В.С.Зарубина, А.П.Крищенко. – М., МГТУ им. Н.Э.Баумана, 2001.
7. Amenc N., V.Le Sourd. Portfolio Theory and Performance Analysis. – Wiley, 2003.
8. Aragonés J., Blanco C. Valor en Riesgo. Aplicación a la gestión empresarial. – Madrid, Piramide, 2000.
9. Blake D. Financial Market Analysis. – L., 1999.
10. Capinski M., Zastawniak T. Mathematics for Finance: An Introduction to Financial Engineering. – Springer, 2005.
11. Clarke R.G. Options and Futures: A Tutorial, 1992.
12. Dowd K. Beyond Value at Risk. The New Science of Risk Management. – Wiley, 1998.
13. Dutilleul R. An Arbitrage Guide to Financial Markets. – Wiley, 1997.
14. Elton E., Gruber M., Brown S., Goetzmann W. Modern Portfolio Theory and Investment Analysis. – Wiley, 2003.
15. Farrel J.L. Portfolio Management. 2-nd ed. – McGraw-Hill, 2000.
16. Fernandes P.L., Somalo M.P. Opciones Financieras y Productos Estructurados. 2-nd ed. – McGraw-Hill, 2003.
17. Francis J.C., Taylor R.W. Investments. 2-nd ed. – McGraw-Hill, 2000.
18. Haugen R. Modern Investment Theory. 5-th ed. – Prentice Hall, 2001.
19. Hull J. Options, Futures and Other Derivatives. 4-th ed. – Prentice-Hall, 2000.

20. Knop R., Ordovas R., Vidal J. Medicion de Riesgos de Mercado y Credito. – Barcelona, 2004.
21. Kolb R.W. The Investor's Complete Toolkit. – New York Institute of Finance, 1991.
22. Jorion Ph. Value at Risk. 2-nd ed. – N.Y., 2000.
23. Markowitz H. Portfolio Selection. – Blackwell Publishers, 1995.
24. Martellini L., Priaulet Ph., Priaulet S. Fixed-Income Securities. Valuation, Risk Management and Portfolio Strategies. – Wiley, 2003.
25. Moreno J. Los Mercados Financieros y sus Matematicas. Una Guia Teorica y Practica para Comprender las Matematicas de los Mercados. – Ariel, Barcelona, 2004.
26. Olivier de La Grandville. Bond Pricing and Portfolio Analysis. – The MIT Press, 2001.
27. Pena J.I. La Gestion de Riesgos Financieros de Mercado y Credito. – Prentice Hall, 2002.
28. Skinner F. Pricing and Hedging Interest and Credit Risk Sensitive Instruments. – Elsevier Butterworth-Heinemann, 2005.
29. Van Deventer D.R., Imai K., Mesler M. Advanced Financial Risk Management – Wiley, 2005.
30. Wilmott P. Quantitative Finance. – Wiley, 2000.
31. RiskMetrics™ Technical Document. 3-d ed. – N.Y., 1995
32. RiskMetrics™ – Technical Document. 4-th ed. N.Y., 1996
33. Ruiz G., Jimenez J., Torres J. La Gestion del Riesgo Financiero. – Madrid, Piramide, 2000.
34. Suarez A. Decisiones Optimas de Inversion y Financiacion en la Empresa. – Madrid, Piramide, 2003.