

# Содержание

<b>Предисловие</b> .....	<b>4</b>
<b>Введение</b> .....	<b>6</b>
<b>Часть I. Инвестиционный процесс и его оценивание</b> .....	<b>9</b>
Глава 1. Инвестиции, инвестиционный процесс и управление инвестициями .....	9
Глава 2. Финансовые сделки и их оценивание .....	21
Глава 3. Расчет простых портфельных сделок .....	42
Глава 4. Временная декомпозиция финансовых сделок .....	58
Глава 5. Фондовые индексы .....	78
<b>Часть II. Оптимальные портфели ценных бумаг</b> .....	<b>88</b>
Глава 6. Вероятностная модель рынка .....	88
Глава 7. Параметрическая модель рынка .....	98
Глава 8. Модели Блека и Марковица в теории портфеля .....	115
Глава 9. Проблема выбора оптимального портфеля .....	130
Глава 10. Модель Тобина—Шарпа—Линтнера .....	142
Глава 11. Модели финансовых рынков .....	151
<b>Часть III. Активы с фиксированной доходностью</b> .....	<b>174</b>
Глава 12. Инструменты денежного рынка .....	174
Глава 13. Облигации .....	181
Глава 14. Временная структура процентных ставок .....	198
Глава 15. Портфели облигаций .....	215
<b>Приложение</b> .....	<b>230</b>
<b>Литература</b> .....	<b>231</b>