**Сущность, значение портфеля ценных бумаг**

Содержание

Введение

Глава 1. Теоретические основы формирования портфеля ценных бумаг

1.1 Сущность, значение портфеля ценных бумаг

1.2 Типы портфелей ценных бумаг

Глава 2. Управление портфелем ценных бумаг

2.1 Влияние типа инвестиционной стратегии на формирование портфеля ценных бумаг

2.2 Стили управления портфелем

Глава 3. Риск портфельных инвестиций

3.1 Диверсификация портфеля ценных бумаг

3.2 Виды портфельных рисков и их хеджирование

Заключение

Список литературы

Список литературы

1. Общая теория денег и кредита. - М.: ЮНИТИ. - 1995.
2. Закон РК «О рынке ценных бумаг» от 2 июля 2003 года №461 - II.
3. Закон РК «О лицензировании» от 17 апреля 1995 года №2200.
4. Закон РК «Об инвестиционных фондах в Республике Казахстан» от 6 марта 1997 г.
5. Указ РК «О ценных бумагах и фондовой бирже» от 5 апреля 1995 года.
6. Материалы Агентства РК по регулированию и надзору финансового рынка, 2006.
7. Алексеев М. Рынок ценных бумаг. М.: Финансы и статистика, 1992.
8. Гражданский кодекс Республики Казахстан: общая часть. - Алматы: Жетi Жаргы, 1995. - 427 с.
9. Закон РК Об акционерных обществах. Ст. 36 // Казахстанская правда. 1998 г. 21-25 июля.
10. Мурзин Д.В. Ценные бумаги - бестелесные вещи. М.: Изд-во «Статус», 1998. С. 103.
11. Ческидов Б.М. Модели рынков ценных бумаг. - СПб.: Питер, 2006
12. А. Нургазина. Модели рынков ценных бумаг // РЦБК. - 2006 - №15. - с. 36-41.
13. Миркин Я.М. // Рынок ценных бумаг. - 2000. - №2. - с. 9-11.
14. Данилов А. «Оздоровление государственных финансов: Поучительный опыт Японии 80\_х-нач. 90\_х гг.». // «Экономические науки». 1991. №10.
15. Markowitz H. Porfolio Selection: Efficient Diversification of Investments. 1959.
16. Шарп У., Александер Г., Бэйли Дж. Инвестиции: Пер. с англ. - М.: ИНФРА\_М, 1999 - XII.
17. Сорос Д. Кризис мирового капитализма. - М.: Инфра. - 1999.
18. Fama E.F. Market efficiency, Long-Term Returns and Behavioral Finance. - University of Ghicago Graduate School of Bisiness, Social Science Research Network Electronic Library, June 1997.
19. Фельдман А.Б. Управление корпоративным капиталом. - М.: Финансовая Академия при правительстве РФ, 1999.
20. Меньшиков И.С. Финансовый анализ ценных бумаг. Курс лекций. М.: Финансы и статистика, 1998.
21. А. Нургазина. Деятельность инвестиционных фондов // РЦБК. - 2006. - №19-20. - с. 46-50.