

ВВЕДЕНИЕ	5
<i>Глава 1.</i> ОСНОВНЫЕ КРИТЕРИИ ПРИНЯТИЯ ОПТИМАЛЬНЫХ ПОРТФЕЛЬНЫХ РЕШЕНИЙ	9
1.1. Функции полезности в моделировании портфельных решений	9
1.2. Оценка и интерпретация рисков на фондовом рынке	17
1.3. Гипотезы теории инвестиционных решений на рынке ценных бумаг	27
<i>Глава 2.</i> ПОРТФЕЛЬНЫЙ АНАЛИЗ НА ОСНОВЕ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИХ МОДЕЛЕЙ С ДИСКРЕТНОЙ ЗАВИСИМОЙ ПЕРЕМЕННОЙ	37
2.1. Моделирование доходности в случайной среде альтернативных ожиданий	37
2.2. Дважды бинарный метод построения модели при моделировании портфельных решений	49
2.3. Диагональная вероятностная модель портфельного инвестирования	59
<i>Глава 3.</i> НОВЫЕ ПОДХОДЫ К МОДЕЛИРОВАНИЮ ПОРТФЕЛЬНЫХ РЕШЕНИЙ	71
3.1. Построение модели портфельного инвестирования на основе рыночного взаимодействия финансовых активов	71
3.2. Алгоритмический подход к построению портфеля на основе парного взаимодействия активов	78
3.3. Ранговые решения в портфельном анализе	83
3.4. Особенности подходов и моделей портфеля ценных бумаг	98

<i>Глава 4.</i> МОДЕЛИРОВАНИЕ ПОРТФЕЛЯ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ПРОЕКТОВ	101
4.1. Элементы модели формирования портфеля проектов.....	102
4.2. Модель 1 с целевым доходом.....	110
4.3. Модель 2 с логическими связями	118
4.4. Модель 3 с логико-финансовыми связями.....	126
БИБЛИОГРАФИЧЕСКИЙ СПИСОК	138
ПРИЛОЖЕНИЯ	151