

**Міністерство освіти України
Запорізький національний технічний університет
Бібліотека**

Керування портфельними інвестиціями

**Рекомендаційний покажчик
літератури**

**Запоріжжя
2003**

За останні роки програми підготовки економістів у вузах України зазнали докорінних змін. На економічних факультетах почали викладати сучасні курси економіки: теорію мікроекономіки, теорію макроекономіки, менеджмент, маркетинг та інші. Глибоке їх засвоєння студентами є основою для розуміння ринкових механізмів господарювання і потребує поліпшення підготовки з проблем інвестицій, ризику і прогнозу. Як оцінювати діяльність банків і страхових компаній? Як поліпшити надійність операцій на страхово-фінансовому та інвестиційному ринках? Як спрогнозувати розвиток суспільно-економічних явищ і процесів в Україні?

Вирішити ці проблеми нам допомагає інвестиційний менеджмент. Інвестиційний менеджмент вимагає здійснення різноманітних фінансово-економічних розрахунків, пов'язаних з потоками грошових коштів у різні періоди часу.

Складовою частиною інвестиційного менеджменту – портфельна теорія. У 1952 році доктор Гаррі Марковіц, якого називають батьком сучасної портфельної теорії, опублікував свою фундаментальну роботу в журналі *Journal of Finance* під назвою “Portfolio selection”. Портфель являє собою набір цінних паперів (проектів) і рішення інвестора про вкладення грошових коштів у конкретні цінні папери (проекти) еквівалентності до вибору оптимального портфеля з набору можливих портфелів. Тому подібну проблему часто називають проблемою вибору інвестиційного портфеля.

Цей показник складено на допомогу вивчаючим сучасну економічну теорію, фінансову теорію, майбутнім менеджерам.

Показник може представляти інтерес як для студентів так і для викладачів вузів. До нього входять книги, статті з журналів, які є в бібліотеці університету за період з 1993 по 2003 роки українською та російськими мовами.

Матеріал розташовано за розділами, усередині кожного розділу – за алфавітом авторів та заголовків.

1. Інвестиційні портфелі.

- 1. У50
Б 19** **Бакаєв Л.О.** Кількісні методи в управлінні інвестиціями : Навч.посібник. – К.,2000. –
Розд.2. Оцінка ефективності інвестицій в довгострокові цінні папери. – С. 22 – 36.
Розд.6. Проблеми вибору портфелів інвестиційних проектів. – С. 100 – 114.
- 2. У50
Б 68** **Бланк И.А.** Инвестиционный менеджмент. – К., 1995. –
Гл.7. Формирование и оценка инвестиционного портфеля компании. – С. С.219 – 248.
- 3. У50
Б 75** **Боди Э.** Принцип инвестиций /Боди З., Кейн А., Маркус.А.Дж. – М.,2002. -
Ч. VI. Активное управление инвестициями. Гл.19. Активное управление и оценка его эффективности. – С. 869 – 914.
- 4. У50
Б 86** **Бочаров В.В.** Инвестиционный менеджмент . – СПб, 2000. –
Гл.3.Экономическое содержание и назначение финансовых инвестиций. 3.3. Основные модели классического портфельного инвестирования.- С. 69 – 78.
Гл.4.Анализ современного состояния портфельных инвестиций в России. - С.79 – 103.
Гл.5.Управление портфелем ценных бумаг акционерного общества и методы оптимизации. – С. 113 – 147.
- 5. У50
Б 88** **Бромвич М.** Анализ экономической эффективности капиталовложений. – М.,1996. -
14.Основы теории инвестиционного портфеля. – С.339 – 367.
15.Анализ инвестиционного портфеля. Оценка и отбор инвестиционных проектов. – С. 371 – 407.
- 6. У526
В 49** **Винс Р.** Математика управления капиталом: Методы анализа риска для трейдеров и портфельных менеджеров: Пер. с англ. – М.: Альпина. – 2000. – 400 с.
- 7. У50
Г 51** **Гитман Л.Дж., Джонк М.** Основы инвестирования. – М.,1997. –
Ч.VI. Инвестиционное управление. Гл.16.Управление портфелем ; Гл.17.Мониторинг инвестиционного портфеля. – С.798 – 879.
- 8.** **Гнилитская Е.** Мировой инвестиционный рынок: Существующие риски и место России в мнжународном портфеле//Управление рисками. – 2001. - № 1. – С.15 - 26

19. У526
М 71 **Мишкін Ф.С.** Економіка грошей банківської справи і фінансових ринків: Пер. с англ. – К.,1998. –
Математичний додаток до розділу 5. Моделі оцінок активів на ринку капіталів (портфель). – С. 865 – 667.
20. У50
П 57 **Попков В.П., Семенов В.П.** Организация и финансирование инвестиций. – СПб.,М., Харьков, Минск, 2001. – 222 с.
21. У526
П 60 Портфель конкуренции и управления финансами: Книга конкурента по финансам. Книга антикризисного управляющего. – М.,1996. – 734 с.
22. У9(4Рос)
П 60 Портфель приватизации и инвестирования. Книга собственника. Книга акционера. Книга инвестиционного менеджера. – М.:Соминтэк, 1992 . – 750 с.
23. У526
П 76 **Примостка Л.О.** Фінансовий менеджмент банку: Навч.посібник. – К.,1999. –
3.2. Управління дохідністю кредитного портфеля та методи ціноутворення за кредитами. – С. 79 – 85.
- 24 У521
Р 18 **Райзберг Б.А.** Курс управления экономикой. – СПб, 2003. –
Гл.15. Управление инвестициями и инвестиционными проектами. – С. 403 – 432.
25. У50
Р 33 **Редченко К.І.** Стратегічний аналіз у бізнесі: Навч. Посібник. – Львів,2003. –
Тема 12. Стратегічний аналіз інвестиційних проектів. – С. 220 - 236.
26. У526
Р 95 Рынок ценных бумаг:Учебник / Под ред. А.И.Басова. – М.,1996. –
Гл.23. Основы портфельного инвестирования. - С.329 – 347.
27. У50
С 13 **Савчук В.П.** и др. Анализ и разработка инвестиционных проектов / В.П.Савчук, С.И.Прилипко, Е.Г.Величко. – К. 1999. – 303 с.
28. У50
С 32 **Серов В.М.** Инвестиционный менеджмент: Учеб пособие. – М.,2000. –
Гл. 8. Экономика и организация портфельных инвестиций. – С. 177 – 207.
29. У526
Т 66 **Трнев И.И.** Управление финансами: Учеб пособие. – М., 1999. –
Гл.20. Составление портфеля. – С. 223 – 237.

- 30. У50
Ф 27** **Фатхутдинов Р.А.** Инновационный менеджмент: Учебник. – М., 2000. –
Тема 9. Формирование портфеля новшеств и инноваций. – С. 359 – 416.
- 31. У50
Ф12** **Фабоцци Ф.Дж.** Управление инвестициями : Пер. с англ.. – М.,2000. –
Гл.4. Теория портфеля: [Доходность портфеля. Диверсификация портфеля. Выбор портфеля]. – С.65 – 90.
Гл.24. Управление портфелем облигаций. – С.583 – 742.
Гл.29. Измерение эффективности инвестиций. – С. 733-752.
Гл.30. Оценка эффективности управления инвестициями. – С. 753 – 778.
- 32. У50
Ф 33** **Федоренко В. Г., Гойко А.Ф.** Инвестозавство : Підручник. - К.,2000. –
Розд.6. Цінні папери та фінансові інвестиції. – С. 61-78.
Розд.13. Інвестиційний проект. – С. 284 – 291.
Розд. 18. Оцінювання ефективності інвестицій. - С.371-377.
- 33. У50
Ш 26** **Шарп У.Ф.** и др Инвестиции / Шляп У.Ф.,Александр Г.Дж., Бэйли Дж.В. - М., 1999. –
Гл.7. Проблема выбора инвестиционного портфеля. – С.169 – 171.
Гл.8. Портфельный анализ. – С. 195 – 230.
- 34. У526
Э 62** **Энг М.В.** др. Мировые финансы: Пер. с англ./Энг М.В., Лис Ф.А., Мауэр Л.Дж. – М., 1998. –
Гл. 19. Международная диверсификация портфелей. – С. 640 – 682.

2. Фінансові портфелі.

- 35. У526
Б 20** **Балабанов И.Т.** Основы финансового менеджмента : Как управлять капиталом? – М., 1994. –
Финансовые ресурсы и капитал. Портфельные инвестиции. – С. 72 – 77.
- 36. У526
Б 27** **Басовский Л.Е.** Финансовый менеджмент: Учебник. – М.,2002. –
[Гл.1.] Теория портфеля и модель оценки доходности финансовых активов. – С. 14 – 15.

- 37. У 50
Б 48** **Бланк И.А.** Инвестиционный менеджмент: Учебный курс. – К.,2001. –
Гл.10. Оценка инвестиционных качеств отдельных финансовых инструментов инвестирования. – С. 306 – 341.
Гл.11. Управление формированием и реструктуризацией портфеля финансовых инвестиций. – С. 312 – 372.
- 38. У50
Б 48** **Бланк И.А.** Основы инвестиционного менеджмента: В 2-х т. Т.2. – К.,2001. –
Гл.14. Управление формированием и реструктуризацией портфеля финансовых инвестиций. – С. 59 – 95.
Гл.14.4. Формирование портфеля финансовых инвестиций. – С. 106 – 117.
Гл.14.5. Оперативное управление портфелем финансовых инвестиций. – С. 117 – 129.
- 39. У526
Б 68** **Бланк И.А.** Словарь – справочник финансового менеджера. – К., 1998. –
[Портфель]. – С. 286 – 287.
- 40. У526
Б 68** **Бланк И.А.** Управление активами. – К., 2000. –
Гл.13.4. Формирование портфеля финансовых инвестиций. – С. 476 – 485.
Гл.13.5. Оперативное управление портфелем финансовых инвестиций. – С. 485 – 496.
- 41. У526
Б 68** **Бланк И.А.** Управление денежными потоками. – К.,2002. –
Гл.13.3. Оценка рисков отдельных финансовых инструментов инвестирования. – С. 469 – 476.
- 42. У526
Б 68** **Бланк И.А.** Финансовый менеджмент: Учеб курс. – К.,2001. –
Разд.IV. Гл.12. Управление финансовыми инвестициями. 12.3. Формирование портфеля финансовых инвестиций. – С. 383 – 392.
- 43. У526
Б 86** **Бочаров В.В.** Финансовое моделирование :Учеб пособие. – СПб., М., Харьков, Минск, 2000. –
Гл.6. Моделирование рациональной структуры инвестиционного портфеля. – С. 121 – 200.
- 44. У526
Г 55** **Глухов В.В., Бахрамов Ю.М.** Финансовый менеджмент (Участники рынка, инструменты, решения) : Учеб пособие. – СПб., 1995. –
Гл.3. Принятие финансовых решений. – С. 285 – 287.
- 45. У526
Г 83** **Гридчина М.В.** Финансовый менеджмент: Курс лекций. – К.,1999. –
Тема 7. Управление инвестиционным портфелем предприятия. – С. 83 – 106.

46. У9(4Рос)
И 58
Инвестиционный финансовый портфель : Книга инвестиционного менеджера. Книга финансового менеджера. Книга финансового посредника. – М.: Соминтэк, 1993. – 478 с.
47. У526
К 79
Крейнина М.И. Финансовый менеджмент: Учеб пособие. – 2-е изд., пер и доп. – М.,2001. –
Гл.10.1. Портфель финансовых активов. – С.274 – 278.

3. Портфелі цінних паперів.

48. У526
Б 48
Бердникова Т.Б. Рынок ценных бумаг и биржевое дело: Учебное пособие. – М.,2001. –
Тема 16. Подходы к формированию портфелей ценных бумаг. – С 236 – 248.
49. У526
Б 87
Брейли Р., Майерс С. Принципы корпоративных финансов: Учебник. – М., 1997 . –
Ч II. Риск. Гл.7–3.Вычисление портфельного риска. – С. 149 – 153.
Гл.7-4. Как отдельные ценные бумаги влияют на портфельный риск. – С. 153–158. Гл.8-4.Гарри Маркович и рождение теории Портфеля. – С. 167-173.
50. У526
В 17
Ван Хорн Дж.К., Вахович Д.М. Основы финансового менеджмента. Пер с англ. - 11-е изд. – М,2001. –
[Гл.9] Инвестирование денежных средств в рыночные ценные бумаги. Портфель рыночных ценных бумаг: три сегмента. – С. 325 – 326.
51. У526
В 59
Власова В.М. Основы предпринимательской деятельности. Финансовый менеджмент: Учеб пособие. – М., 1999. –
Гл.3.4. Анализ портфеля ценных бумаг предприятия. – С. 72 – 78.
52. У526
М 31
Маслова С.О., Опалов О.А. Финансовый рынок : Навчальний посібник. – К.,2003. –
Тема 9. Формування портфеля цінних паперів. – С.207-222.
53. У526
М 47
Меркумов Я.С. Финансовые вычисления. Теория и практика: Учебно-справочное пособие. – М.,2002. –
Гл.IX. Анализ эффективности инвестиций в облигации и акции. – С. 192 – 234.
54. У526
П 26
Первозванский А.А., Первозванская Т.И Финансовый рынок: расчет и риск. – М.,1994. –
Гл.6. Портфель ценных бумаг. – С. 79 – 114.

55. У526
Ф 59
Финансовый менеджмент : Учебно-практическое руководство. – М., 1998. –
Гл.12. Управление портфелем ценных бумаг предприятий и организаций. – С. 226 – 247.
56. У526
Ч-49
Чернецкая Г.Ф. Рынок ценных бумаг и биржевое дело: Практикум. – М., 2001. –
9. Макроэкономический анализ рынка ценных бумаг. Эффективность инвестиционного портфеля. – С. 71 – 75.
57. У50
Я 62
Янковский К., Мухарь И. Организация инвестиционной и инновационной деятельности. – СПб., 2001. –
Гл.6. Инвестиции и ценные бумаги. – С. 118 – 131.
Гл.7. Формирование портфеля инвестиций предприятия. – С. 138 – 161.
Гл.8. Экономическая эффективность инвестиционного проекта. – С. 162 – 192.

4. Портфелі та банківські операції.

58. У526
Б 23
Банківські операції: Підручник / За ред А.М.Мороза. – К.,2002. –
Гл.6.3. Інвестиційні операції банків з цінними паперами. – С. 239 – 252.
Гл.7. Інвестиційні банківські операції. – С. 262 – 297.
59. У526
Б 19
Банковский менеджмент : Учеб пособие /Под ред. Кириченко А.А. – К.,1998. –
Гл.13.Особенности управления активами банка. 13.5. Влияние кредитного портфеля на стабильность банка. – С. 498-502.
60. У526
В 20
Васюренко О.В. Банківський менеджмент:Посібник. – К., 2001. –
Розд.5. Управління інвестиційною діяльністю банку. Особливості управління банківськими інвестиціями. Інвестиційний портфель цінних паперів. – С. 198 – 210.
61. У 526
Д 34
Деньги.Кредит.Банки.Ценны бумаги: Практикум: Учеб пособие /Под ред. Е.Ф.Жукова. – М.,2001. –
Гл.4. Коммерческие банки. §4. Формирование и управление инвестиционным портфелем. – С. 129 – 164.
62. У526
К 43
Кириченко О. та інш. Банківський менеджмент: Навч. Посібник /О.Кириченко, І.Гіленко, А.Ятченко. – К., 1999. –
13.5. Вплив кредитного портфеля на стабільність банку. – С. 497 – 501.

Авторський покажчик

Александр Г. Дж.	- 33	Ли Ч.О.	- 15
Бакаєв Л.О	-1	Лис Ф.А.	- 34
Балабанов И.Т	- 35	Майерс С.	- 49
Басовский Л.Е.	- 36	Мансухами Г.Р.	- 16
Бахрамов Ю.М.	- 44	Маслова С.О	- 52
Бланк И.А	- 2,37,38,39,40, 41,42	Мауэр Л.Дж.	- 34
Боди Э.	- 3	Меркулов Я.С.	- 53
Бочаров В.В	- 43	Мертенс А	- 17
Брейли Р	- 49	Мышкин Ф.С.	- 19
Бромвич М	- 5	Мухарь И.	- 57
Бэйли Дж.В.	- 33	Опалов О.А	- 52
Васюренко О.В.	- 60	Первозванская Т.И.	- 54
Величко Е.Г.	- 27	Первозванский А.А.	- 54
Ван Хорн Дж.К.	- 50	Попков В.П.	- 20
Вахович Д.М	- 50	Прилипко С.И..	- 27
Винс Р.	- 6	Примостка Л.О.	- 23
Власова М.В	- 51	Раєвський К.Є.	- 11
Гіленко І.	- 62,65	Райзберг Б.А	- 24
Гитман Л.Д.	- 7	Редченко К.І.	- 25
Глухов В.В.	- 44	Родригес Р.Дж.	- 13
Гнилитская Е.	- 8	Савчук В.П.	- 27
Гойко А.Ф.	- 32	Семенов В.П.	- 20
Гридчина М.В	- 45	Серов В.М.	- 28
Губский В.В.	- 9	Такки К.	- 12
Джонк М.	- 7	Тренев И.И.	- 29
Дуглас Л.Г..	- 10	Фабоцци Ф.Дж	- 31
Слейко Я.І	- 11	Фатхутдинов Р.А.	- 30
Слейко О.І.	- 11	Федоренко В.Г.	- 32
Кириченко О.	- 62	Финнерти Д.И.	- 15
Ковни Ш.	- 12	Чернецкая Г.Ф.	- 56
Колб Р.В	- 13	Шарп У.Ф.	- 33
Коссов В.В.	- 14	Энг М.В.	- 34
Крейнина М.И.	- 47	Ятченко А	- 62
		Янковский К.	- 57

Зміст

1. Інвестиційні портфелі.....	4
2. Фінансові портфелі.....	7
3. Портфелі цінних паперів.....	9
4. Портфелі та банківські операції.....	10
Авторський показник.....	11