

Изучаем системный анализ финансового рынка.

Учебник. Асват Инвестиционная оценка активов

1 Системный Анализ Финансового рынка

1.1 Рыночный риск

1. Валютный
2. Процентный
3. Фондовый

Рыночные рынки управляются хеджированием.

В теории инвестиций существуют ряд моделей для измерения риска доходности

$$PV = \sum_{i=1}^n \frac{CF_i}{(1 + r_i)^n} \quad (1)$$

1. n срок жизни финансового актива
2. CF_i cash flow (денежный поток) в момент времени i
3. r_i ставка дисконтирования