

**Риск процентной ставки***Содержание***Раздел 1. Процентные инструменты и процентный риск**

Глава 1. Инструменты

Глава 2. Контроль риска процентной ставки

**Раздел 2. Процентные ставки**

Глава 3. Расчет процентных ставок

Глава 4. Кривые доходности

**Раздел 3. Анализ дюрации**

Глава 5. Дюрация

Глава 6. Иммунизация

**Раздел 4. Модели процентных ставок и оценка процентных инструментов с неопределенными платежами**

Глава 7. Модели

Глава 8. Оценка

**Раздел 5. Производные инструменты**

Глава 9. Форварды, фьючерсы, свопы

Глава 10. Опционы и встроенные опционы

**Раздел 6. Портфель процентных инструментов**

Глава 11. Измерение процентного риска и эффективность управления портфелем

Глава 12. Модели управления процентным риском