

O‘ZBEKISTON RESPUBLIKASI OLIY TA‘LIM, FAN VA
INNOVATSIYALAR VAZIRLIGI
TOSHKENT DAVLAT IQTISODIYOT UNIVERSITETI

Qo‘lyozma huquqida
UDK: 330.322:005.915

TURSUNXODJAYEVA SHIRIN ZAFAR QIZI

INVESTITSIYA PORTFELINI SHAKLLANTIRISHDA MOLIYAVIY
RISKLARNI BOSHQARISH METODOLOGIYASINI TAKOMILLASHTIRISH

08.00.07 — Moliya, pul muomalasi va kredit

Iqtisodiyot fanlari doktori (DSc)
ilmiy darajasini olish uchun yozilgan
DISSERTATSIYA

Ilmiy maslahatchi: Jumayev Nodir Xosiyatovich, iqtisodiyot fanlari doktori, professor.

Toshkent – 2025-yil

MUNDARIJA

	bet
KIRISH	3
I BOB INVESTITSIYA PORTFELINI SHAKLLANTIRISHNING NAZARIY-METODOLOGIK ASOSLARI	
1.1. Investitsiya portfelini shakllantirishning nazariy asoslari.....	16
1.2. Investitsiya portfelini shakllantirishning chiziqli modellari.....	30
1.3. Investitsiya portfelini shakllantirishning chiziqsiz modellari.....	43
1.4. Investitsiya portfelining optimallashtirish muammolari	60
I bob bo'yicha xulosalar.....	76
II BOB INVESTITSIYA PORTFELINI SHAKLLANTIRISHDA MOLİYAVIY RISKLARNI BAHOLASHNING NAZARIY-METODOLOGIK ASOSLARI	
2.1. Investitsiya portfelini shakllantirishda moliyaviy risklarni baholashning nazariy asoslari.....	78
2.2. Investitsiya portfelini shakllantirishda moliyaviy risklarni baholashning statistik modellari.....	92
2.3. Investitsiya portfelini shakllantirishda moliyaviy risklarni baholashning kvantilli modellari.....	108
II bob bo'yicha xulosalar.....	123
III BOB INVESTITSIYA PORTFELINI SHAKLLANTIRISHDA MOLİYAVIY RISKLARNI BAHOLASH	
3.1. Investitsiya portfelini shakllantirishda moliyaviy risklarni statistik modellar orqali baholash.....	125
3.2. Investitsiya portfelini shakllantirishda moliyaviy risklarni kvantilli modellar orqali baholash.....	142
3.3. Investitsiya portfeli samaradorligiga ta'sir qiluvchi omillarning ekonometrik tahlili.....	158
III bob bo'yicha xulosalar.....	175
IV BOB INVESTITSIYA PORTFELINI SHAKLLANTIRISHDA MOLİYAVIY RISKLARNI BOSHQARISHNI TAKOMILLASHTIRISH	
4.1. Investitsiya portfelini shakllantirishda moliyaviy risklarni boshqarish metodologiyasini takomillashtirish	177
4.2. Investitsiya portfelini shakllantirishda moliyaviy risklarni boshqarishda hedjirlashdan foydalanish	198
4.3. Investitsiya portfeli daromadliligini o'rta muddatli prognozlash	211
IV bob bo'yicha xulosalar.....	226
XULOSA.....	228
FOYDALANILGAN ADABIYOTLAR RO'YXATI.....	232