

Spis treści

Rozdział 1	
ISTOTA INWESTYCJI FINANSOWYCH (<i>Katarzyna Perez</i>).....	5
1.1. Definicja inwestycji finansowych	5
1.2. Charakterystyka inwestorów	7
1.2.1. Miejsce inwestorów na rynku finansowym.....	7
1.2.2. Cele i ograniczenia inwestorów	10
1.3. Rodzaje instrumentów finansowych.....	24
Rozdział 2	
ANALIZA INSTRUMENTÓW FINANSOWYCH WCHODZĄCYCH W SKŁAD PORTFELA INWESTYCYJNEGO (<i>Jacek Truszkowski</i>)	40
2.1. Analiza fundamentalna.....	40
2.1.1. Wycena obligacji	40
2.1.2. Wycena akcji.....	44
2.1.3. Wycena instrumentów pochodnych	48
2.2. Analiza techniczna	70
2.2.1. Klasyczna analiza wykresów	71
2.2.2. Wskaźnikowa analiza techniczna.....	75
Rozdział 3	
PODSTAWY NOWOCZESNEJ TEORII PORTFELA (<i>Katarzyna Perez</i>)	94
3.1. Stopa zwrotu i ryzyko inwestycyjne	94
3.1.1. Stopa zwrotu	94
3.1.2. Ryzyko inwestycyjne	99
3.2. Model Markowitza	111
3.3. Modele rynku kapitałowego	125
Rozdział 4	
DOCHODOWOŚĆ I EFEKTYWNOŚĆ PORTFELA INWESTYCYJNEGO (<i>Katarzyna Perez</i>)	156
4.1. Istota dochodowości i efektywności portfela inwestycyjnego	156
4.2. Miary dochodowości i ryzyka portfela inwestycyjnego	160
4.3. Miary efektywności portfela inwestycyjnego	174
Rozdział 5	
ZABEZPIECZENIE PORTFELA INWESTYCYJNEGO (<i>Jacek Truszkowski</i>)	189
5.1. Strategie zabezpieczające wykorzystujące kontrakty <i>forward/futures</i>	190
5.2. Strategie zabezpieczające wykorzystujące opcje	192