

Spis treści

Rozdział 1	
ISTOTA INWESTYCJI FINANSOWYCH (<i>Katarzyna Gabryelczyk</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	
PODSTAWY NOWOCZESNEJ TEORII PORTFELA	39
2.1. Stopa zwrotu i ryzyko inwestycyjne (<i>Katarzyna Gabryelczyk</i>)	39
2.1.1. Stopa zwrotu	39
2.1.2. Ryzyko inwestycyjne	41
2.2. Model Markowitza (<i>Katarzyna Gabryelczyk</i>)	57
2.3. Modele rynku kapitałowego (<i>Katarzyna Gabryelczyk, Jacek Truszkowski</i>)	68
Rozdział 3	
ANALIZA INSTRUMENTÓW FINANSOWYCH WCHODZĄCYCH W SKŁAD PORTFELA INWESTYCYJNEGO (<i>Jacek Truszkowski</i>)	90
3.1. Analiza fundamentalna	90
3.1.1. Wycena obligacji	90
3.1.2. Wycena akcji	94
3.1.3. Wycena instrumentów pochodnych	97
3.2. Analiza techniczna	120
3.2.1. Klasyczna analiza wykresów	121
3.2.2. Wskaźnikowa analiza techniczna	125
Rozdział 4	
DOCHODOWOŚĆ I EFEKTYWNOŚĆ PORTFELA INWESTYCYJNEGO (<i>Katarzyna Gabryelczyk</i>)	144
4.1. Istota dochodowości i efektywności portfela inwestycyjnego	144
4.2. Miary dochodowości i ryzyka portfela inwestycyjnego	149
4.3. Miary efektywności portfela inwestycyjnego	163
Rozdział 5	
ZABEZPIECZENIE PORTFELA INWESTYCYJNEGO (<i>Jacek Truszkowski</i>)	177
5.1. Strategie zabezpieczające wykorzystujące kontrakty <i>forward/futures</i>	178
5.2. Strategie zabezpieczające wykorzystujące opcje	181