

Spis treści

<i>Rynek kapitałowy – w kierunku przyszłości (wprowadzenie)</i> (Teresa Czerwińska, Alojzy Z. Nowak)	7
---	---

CZĘŚĆ I

EFEKTYWNOŚĆ INFORMACYJNA RYNKU KAPITAŁOWEGO

ROZDZIAŁ I

<i>Unia Rynków Kapitałowych</i> – wpływ na rynek kapitałowy w Polsce (Iwona Sroka)	15
---	----

ROZDZIAŁ II

<i>Iluzja wiedzy finansowej jako zagrożenie dla zwiększania stopnia włączenia finansowego i funkcjonowania rynku finansowego</i> (Bożena Frączek)	27
--	----

ROZDZIAŁ III

<i>Efektywność informacyjna polskiego rynku akcji względem programów opcji menedżerskich (Michał Łukowski)</i>	40
--	----

ROZDZIAŁ IV

<i>Kosztowna sygnalizacja ładu korporacyjnego w spółkach rodzinnych notowanych na NewConnect (Michał Zdziarski)</i>	51
---	----

ROZDZIAŁ V

<i>Długookresowe zależności między zmiennymi makroekonomicznymi a subindeksami giełdowymi (Hubert Wiśniewski)</i>	63
---	----

ROZDZIAŁ VI

<i>Wpływ publikacji informacji o wykluczeniu spółek z indeksu WIG20 na ich stopę zwrotu (Tomasz Miziołek)</i>	74
---	----

ROZDZIAŁ VII

<i>Wpływ praktyk corporate governance na wyniki banków. Badanie panelowe dla krajów europejskich (Renata Karkowska)</i>	87
---	----

CZĘŚĆ II. STRATEGIE I INSTRUMENTY RYNKU KAPITAŁOWEGO

ROZDZIAŁ VIII

- Dynamika płynności w okresach znaczących zmian cen akcji* (Barbara Będowska-Sójka) 101

ROZDZIAŁ IX

- Modelowanie procesu price discovery na przykładzie indeksu wina Liv-ex Fine Wine 50* (Jacek Suder) 115

ROZDZIAŁ X

- Analiza wieloczynnikowa stóp zwrotu z indeksów giełdowych z uwzględnieniem reżimów zmienności w zależności od stopnia rozwoju rynku* (Paweł Sakowski, Robert Ślepaczuk, Mateusz Wywiół) 129

ROZDZIAŁ XI

- Zwiększone fundusze indeksowe na GPW – aktywne strategie zwiększające zwroty funduszy indeksowych* (Patrycja Chodnicka-Jaworska, Piotr Jaworski) 148

ROZDZIAŁ XII

- Czy warto być społecznie odpowiedzialnym? – analiza efektywności i ryzyka funduszy inwestycji społecznie odpowiedzialnych* (Tomasz Jedynak) 158

ROZDZIAŁ XIII

- Efektywność inwestycji w akcje spółek wdrażających koncepcję CSR – studium przypadku indeksu RESPECT z wykorzystaniem metody dominacji stochastycznej* (Klaudia Jarno) 171

ROZDZIAŁ XIV

- Model Hestona – wycena opcji europejskich i analiza alternatywnych podejść pod względem szybkości obliczeniowej* (Arkadiusz Orzechowski) .. 180

ROZDZIAŁ XV

- Opcje towarowe jako instrumenty dywersyfikacji ryzyka zmiany cen na rynkach rolnych* (Piotr Giruć) 192