

INWESTYCJE Instrumenty finansowe, ryzyko...

Jajuga Krzysztof, Jajuga Teresa

SPIS TREŚCI

Przedmowa

Wprowadzenie - badania w zakresie inwestycji i finansów

Literatura

Rozdział 1. Rynki i instrumenty finansowe

1.1. Instrumenty finansowe - wprowadzenie

1.2. Instrumenty rynku pieniężnego

1.3. Obligacje

1.4. Akcje i inne instrumenty udziałowe

1.5. Instrumenty pochodne – wprowadzenie

1.6. Opcje

1.7. Kontrakty terminowe forward i futures

1.8. Kontrakty swap

1.9. Rynki finansowe - uczestnicy i funkcjonowanie

1.10. Indeksy rynku

Uwagi bibliograficzne

Pytania i zadania

Rozdział 2. Wartość pieniądza w czasie - podstawa analizy inwestycji

2.1. Wartość pieniądza w czasie – wprowadzenie

2.2. Wartość przyszła

2.3. Wartość obecna

2.4. Stopa procentowa i stopa zwrotu

Uwagi bibliograficzne

Pytania i zadania

Rozdział 3. Analiza instrumentów dłużnych

3.1. Wycena instrumentów rynku pieniężnego

3.2. Wycena obligacji

3.3. Stopa dochodu obligacji i jej właściwości

3.4. Struktura terminowa stóp procentowych

3.5. Ryzyko inwestycji w obligacje - wprowadzenie

3.6. Pomiar ryzyka stopy procentowej

3.7. Strategie inwestowania w obligacje

Uwagi bibliograficzne

Pytania i zadania

Rozdział 4. Analiza akcji

- 4.1. Metody analizy akcji i efektywność rynku – wprowadzenie
 - 4.2. Analiza fundamentalna akcji
 - 4.3. Wycena akcji
 - 4.4. Analiza i wycena praw poboru i obligacji zamiennych na akcje
- Uwagi bibliograficzne
- Pytania i zadania

Rozdział 5. Analiza dochodu i ryzyka

- 5.1. Pomiar dochodu z inwestycji - oczekiwana stopa zwrotu
 - 5.2. Ryzyko inwestycji – wprowadzenie
 - 5.3. Miary ryzyka inwestycji w akcje
 - 5.4. Ujęcie subiektywne w analizie ryzyka - teoria użyteczności i teoria perspektywy
- Uwagi bibliograficzne
- Pytania i zadania

Rozdział 6. Teoria portfela i modele rynku kapitałowego

- 6.1. Pomiar zależności między stopami zwrotu
- 6.2. Teoria portfela dwóch spółek

- 6.3. Teoria portfela wielu spółek
 - 6.4. Teoria portfela z uwzględnieniem instrumentów wolnych od ryzyka
 - 6.5. Stochastyczna dominacja i inne kryteria tworzenia portfela
 - 6.6. Model jednowskaźnikowy Sharpe'a
 - 6.7. Model rynku kapitałowego – CAPM
 - 6.8. Model rynku kapitałowego – APT
 - 6.9. Elementy zarządzania portfelem
- Uwagi bibliograficzne
- Pytania i zadania

Rozdział 7. Analiza instrumentów pochodnych

- 7.1. Wycena instrumentów pochodnych - wprowadzenie
- 7.2. Wycena opcji - wprowadzenie
- 7.3. Wycena opcji - model dwumianowy
- 7.4. Wycena opcji - model Blacka-Scholesa-Mertona
- 7.5. Wycena opcji - inne zagadnienia
- 7.6. Analiza i wycena kontraktów futures i forward
- 7.7. Wycena kontraktów swap
- 7.8. Strategie inwestycyjne z zastosowaniem instrumentów pochodnych
- 7.9. Zarządzanie ryzykiem z zastosowaniem instrumentów pochodnych
 - podstawy

Uwagi bibliograficzne

Pytania i zadania

Rozdział 8. Analiza inwestycji w przedsiębiorstwie

8.1. Inwestycje w przedsiębiorstwie - wprowadzenie

8.2. Koszt kapitału przedsiębiorstwa

8.3. Analiza projektów inwestycyjnych

8.4. Ryzyko projektów inwestycyjnych

8.5. Opcje realne

Uwagi bibliograficzne

Pytania i zdania

Rozdział 9. Analiza inwestycji na rynku nieruchomości

9.1. Wprowadzenie - inwestycje na rynku nieruchomości a rynek
finansowy

9.2. Analiza inwestycji w nieruchomości

9.3. Wycena nieruchomości

9.4. Analiza instrumentów finansowych rynku nieruchomości

9.5. Zarządzanie ryzykiem inwestycji na rynku nieruchomości

Uwagi bibliograficzne

Pytania i zadania

Rozdział 10. Inwestycje w osobistym planowaniu finansowym

10.1. Finanse osobiste – wprowadzenie

10.2. Inwestycje osoby indywidualnej

Uwagi bibliograficzne

Pytania

Zakończenie

Aneks. Rynek finansowy w Polsce

Indeks