

Nowoczesna teoria portfelowa

Edwin J. Elton, Martin J. Gruber

SPIIS TREŚCI

WPROWADZENIE

1. Wstęp
2. Papiery wartościowe
3. Rynki finansowe

ANALIZA PORTFELOWA

4. Właściwości zbioru możliwości inwestycyjnych w warunkach ryzyka
5. Wyznaczanie portfeli efektywnych
6. Metody wyznaczania granicy efektywnej
7. Struktura korelacji stóp zwrotu z papierów wartościowych: model jednowskaźnikowy
8. Struktura korelacji stóp zwrotu z papierów wartościowych: modele wielowskaźnikowe i techniki grupowania
9. Proste metody wyznaczania granicy efektywnej
10. Analiza użyteczności
11. Inne modele wyboru portfela
12. Dywersyfikacja międzynarodowa

MODELE RÓWNOWAGI NA RYNKACH KAPITAŁOWYCH

13. Standardowy model wyceny dóbr kapitałowych (CAPM)
14. Niestandardowe warianty modelu wyceny dóbr kapitałowych
15. Badania empiryczne modeli równowagi
16. Teoria arbitrażu cenowego - nowa koncepcja wyjaśniania cen instrumentów finansowych

ANALIZA PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH I TEORIA PORTFELOWA

17. Rynki efektywne
18. Proces wyceny
19. Szacowanie zysków
20. Teoria stopy procentowej i wycena obligacji
21. Zarządzanie portfelami obligacji
22. Teoria wyceny opcji
23. Wycena i wykorzystanie finansowych kontraktów futures

OCENA PROCESU INWESTYCYJNEGO

24. Ocena efektywności portfela
25. Ocena analizy papierów wartościowych
26. Powrót do teorii zarządzania portfelem