

Analiza portfela inwestycyjnego dwuskładnikowego wybranych spółek.

Wstęp.....3

Rozdział 1

Instrumenty finansowe

1.1. Pojęcie instrumentu finansowego..... 5

1.2. Rodzaje instrumentów finansowych..... 7

1.3. Dochód i ryzyko jako podstawowe cechy instrumentów portfela15

Rozdział 2

Miary dochodu i ryzyka

2.1. Miary dochodu20

2.2. Miary ryzyka23

2.2.1. Miary wrażliwości..... 23

2.2.2. Miary zmienności24

2.2.3. Miary zagrożenia31

Rozdział 3

Założenia budowy portfela

3.1. Istota teorii dywersyfikacji ryzyka36

3.2. Współczynnik korelacji Pearsona38

3.3. Zasady budowy portfela dwuskładnikowego..... 40

3.3.1. Dochód portfela dwuskładnikowego.....	41
3.3.2. Ryzyko portfela dwuskładnikowego.....	42
3.3.3. Optymalizacja portfela dwuskładnikowego.....	46

Rozdział 4

Portfele inwestycyjne wybranych spółek

4.1. Metodologia badań	49
4.2. Dochód i ryzyko wybranych spółek.....	50
4.3. Portfele dwuskładnikowe	56
4.4. Wybór portfela inwestycyjnego	59
4.5. Rekomendacje dla praktyki – wnioski.....	60

Zakończenie

Spis wykorzystanych źródeł.....

Spis rysunków

Spis tabel