

Ocena jakości zarządzania portfelem funduszu inwestycyjnego – porównanie skuteczności wybranych funduszy o różnych profilach

Wstęp.....4

Rozdział 1

Fundusze inwestycyjne – pojęcie i podział

1.1. Pojęcie funduszu i portfela inwestycyjnego..... 6

1.2. Fundusze inwestycyjne w Polsce..... 6

1.3. Podział funduszy inwestycyjnych..... 7

Rozdział 2

Strategie inwestowania wybranych funduszy

2.1. Altus Akcji (FIO Parasolowy)11

2.2. Legg Mason Obligacji12

2.3. Noble Fund Mieszany14

2.4. Skarbiec Akcja15

2.5. Investor Obligacji16

2.6. Pioneer Zrównoważony..... 17

Rozdział 3

Efektywność funduszy inwestycyjnych – badania empiryczne

3.1. Podstawowe metody oceny funduszy inwestycyjnych..... 19

3.2. Złożone metody oceny funduszy inwestycyjnych..... 27

3.3. Miary skorygowane o ryzyko inwestycyjne30

3.4. Dodatkowe miary40

Podsumowanie..... 42

Spis rysunków i tabel..... 45

Literatura47