

SPIS TREŚCI

Dariusz J. Błaszczuk	9
----------------------------	---

CZĘŚCI

POJĘCIE I ISTOTA ZARZĄDZANIA RYZYKIEM PORTFELA INWESTYCYJNEGO

Dariusz J. Błaszczuk

Pojęcie i istota zarządzania ryzykiem portfela inwestycyjnego w dobie kryzysu.	13
---	----

Michał Hartmann

Ryzyko w finansach i jego klasyfikacja	29
--	----

Ewa Amroziak

Identyfikacja i klasyfikacja ryzyka jako niezbędny element do zarządzania ryzykiem portfela inwestycyjnego.	33
---	----

Michał Hartmann

Sposoby ograniczania ryzyka (dywersyfikacja i korelacja).	37
--	----

Monika Laskowska

Alokacja aktywna jako metoda zarządzania ryzykiem portfela inwestycyjnego w dobie kryzysu.	39
--	----

Anna Banaszek	
Zdywersyfikowany portfel inwestycyjny wg teorii Markowitza.	47
Agata Wasilewska	
Dywersyfikacja jako metoda zabezpieczenia portfela inwestycyjnego.	53
Agnieszka Filipiak	
Wpływ akcji i obligacji na poziom ryzyka portfela inwestycyjnego.	63
Jacek Kuciński	
Papiery dłużne przedsiębiorstw jako składnik portfeli funduszy inwestycyjnych rynku pieniężnego.	69
Anna Jacak	
Znaczenie dywersyfikacji przy zarządzaniu ryzykiem portfela inwestycyjnego.	79
 CZEŚĆ II	
ZARZĄDZANIE RYZYKIEM PORTFELA INWESTYCYJNEGO ZA POMOCĄ INSTRUMENTÓW POCHODNYCH	
Dariusz J. Błaszczuk	
Pojęcie i istota instrumentów pochodnych jako narzędzi zarządzania ryzykiem portfela inwestycyjnego.	83
Małgorzata Gryz	
Ewolucja narzędzi zarządzania ryzykiem.	95
Sylwia Grzybowska	
Istota i rodzaje <i>hedgingu</i>	101
Marta Zielińska	
Istota i rodzaje transakcji pochodnych	105

Michał Hartmann

Przykładowe narzędzia zarządzania (kontrakty *forward* i *futures*).111

Katarzyna Socha

Zastosowanie kontraktów *forward* do zarządzania ryzykiem portfela inwestycyjnego.115

Beata Dziatczyk

Zastosowanie kontraktów *Marsilio* do zarządzania ryzykiem portfela inwestycyjnego.121

Anna Budzisz

Zastosowanie kontraktów opcyjnych do zarządzania ryzykiem portfela inwestycyjnego 127

Sylwia Pszczoła

Strategie inwestycyjne z zastosowaniem opcji.133

Agnieszka Kopacz

Badanie wybranych opcji walutowych.139

Wioletta Magiera

Instrumenty pochodne wykorzystywane do zarządzania ryzykiem finansowym
w przedsiębiorstwie.147

Magdalena Podbielska

Zarządzanie ryzykiem odmowy zapłaty.153

Krzysztof Ozimek

strategia Behawioralna *delta hedging*.159

Maciejewska Joanna

Macro-/?edg//?g\N rachunkowości.169

Kamila Konuszevska

Wpływ portfela inwestycyjnego na wartość firmy, 173

CZEŚĆ III

WYBRANE MIARY RYZYKA PORTFELA INWESTYCYJNEGO

Katarzyna Rogalska

Upadłość Lehman Brothers na tle historii współczynnika adekwatności kapitałowej.179

Ewa Ślusarczyk

Analiza *duration* jako metoda zarządzania ryzykiem stopy procentowej portfela obligacji.187

Magdalena Strzelecka

Zarządzanie ryzykiem cenowym portfela inwestycyjnego.193

Monika Wacławik

Metody pomiaru efektywności zarządzania portfelem aktywów.199

Dariusz J. Błaszczuk205