

Spis treści:

Przedmowa

1.Liberalizacja i globalizacja rynków finansowych

1.1.Globalny rynek finansowy

1.2.Funkcje rynków finansowych

2.Efektywność rynków finansowych

2.1.Formy efektywności rynków finansowych

2.2.Hipoteza efektywności rynków finansowych

2.3.Racjonalność

2.3.1.Racjonalność zachowań

2.3.2.Racjonalność przewidywań

2.4.Twierdzenia o efektywności rynków finansowych

2.5.Generator cen fundamentalnych

2.6.Bańki racjonalne

2.7.Bańki nieracjonalne i manie

2.8.Mimetyzm

2.9.Irracjonalność zachowań

2.10.Anomalie

2.10.1.Wprowadzenie

2.10.2.Efekt końca tygodnia

2.10.3.Efekt końca miesiąca

2.10.4.Efekt końca roku

2.10.5.Efekt wielkości przedsiębiorstwa

2.11.Testowanie hipotezy efektywności informacyjnej

3.Inwestorzy a wahania kursów instrumentów finansowych

3.1.Inwestorzy

3.2.Czartyści

3.3.Metody analizy technicznej

3.3.1.Wprowadzenie

3.3.2.Teoria Dowu

3.3.3.Teoria fal Elliotta

3.3.4.Podstawowe formacje graficzne czartyzmu

3.4.Trend w analizie technicznej

3.4.1.Trend

3.4.2.Wskaźniki dynamiki o podstawie ruchomej

3.4.3.Oscylatory

4.Losowość i szeregi czasowe

4.1.Rozwój metod modelowania

4.2.Proces błędzenia przypadkowego

4.3.Stacjonarność procesu

4.4.Analiza szeregów czasowych

4.5.Modelowanie ARMA i modelowanie VAR

4.6.Predykcja i przyczynowość

4.7.Kointegracja i model korekty błędu

4.8.Od modelowania ARCH do GARCH

4.9.O modelach wielowymiarowych

- 5. Modele w analizie rynków finansowych
 - 5.1. Analiza portfelowa
 - 5.1.1. Użyteczność i ryzyko
 - 5.1.2. Analiza Markowitza
 - 5.1.3. Granica efektywna
 - 5.1.4. Nieklasyczne miary ryzyka i model wartości zagrożonej
 - 5.2. Model wyceny aktywów kapitałowych - CAPM
 - 5.2.1. Model CAPM
 - 5.2.2. Indeksy rynkowe
 - 5.2.3. Model rynku - linia charakterystyczna - współczynnik beta.
 - 5.3. Model wyceny arbitrażowej - APT
 - 5.3.1. Model z antycypacjami racjonalnymi
 - 5.3.2. Model APT
 - 5.4. Model jednowskaźnikowy Sharpe'a
 - 5.5. Ekonometryczne modele jedno- i wieloczynnikowe
 - 5.6. Modele oceny spółek giełdowych - tworzenie i niszczenie wartości

Bibliografia

Indeks