

SPIS TREŚCI

Przedmowa	v
Wprowadzenie: Proces inwestycyjny	1
1 Uwarunkowania inwestycyjne	5
Część pierwsza Zrozumieć klienta	
2 Ryzyko i użyteczność: podstawowe zagadnienia	29
3 Modele ryzyka	61
4 Inne mierniki ryzyka	83
5 Podatkowe aspekty inwestowania	101
Część druga Alokacja aktywów	
6 Zarządzanie w skali globalnej i alokacja aktywów	119
7 Aktywna alokacja	167

Część trzecia Dobór aktywów

- | | | |
|---|--|-----|
| 8 | Dobór aktywów: strategie i ich skuteczność | 191 |
| 9 | Strategia inwestycyjna | 237 |

Część czwarta Realizacja portfela

- | | | |
|----|-------------------------------|-----|
| 10 | Koszty transakcyjne | 259 |
| 11 | Ukryte koszty transakcyjne | 267 |
| 12 | Zarządzanie ryzykiem portfela | 283 |

Część piąta Ocena wyników procesu inwestycyjnego

- | | | |
|----|--|-----|
| 13 | Ocena wyników inwestycyjnych | 337 |
| 14 | podatkowe aspekty oceny wyników inwestycyjnych | 381 |

Część szósta Zarządzanie korporacyjne

- | | | |
|----|---|-----|
| 15 | Zarządzanie korporacyjne w Stanach Zjednoczonych:
lekcja z lat 80. | 397 |
| | Przypisy | 425 |