

Spis treści

Wprowadzenie

Rozdział 1

Fundusze inwestycyjne z ochroną kapitału - Tomasz Miziołek

- 1.1. Istota i najważniejsze cechy funduszy inwestycyjnych z ochroną kapitału .
 - 1.1.1. Poziom ochrony kapitału
 - 1.1.2. Stopień partycypacji w zyskach
 - 1.1.3. Okres rozliczeniowy
 - 1.1.4. Płynność
- 1.2. Konstrukcja funduszy z ochroną kapitału
- 1.3. Fundusze z ochroną kapitału na polskim rynku finansowym
 - 1.3.1. Lata 2000-2002 - trudne początki
 - 1.3.2. Lata 2003-2010 - rozkwit oferty
 - 1.3.3. Stan po 2010 r.

Rozdział 2

Fundusze nieruchomości - Aleksandra Leszczuk

- 2.1. Istota i rodzaje funduszy nieruchomości
- 2.2. Fundusze nieruchomości na świecie
 - 2.2.1. Rynek funduszy nieruchomości w Stanach Zjednoczonych
 - 2.2.2. Rynek funduszy nieruchomości w Republice Federalnej Niemiec
 - 2.2.3. Rynek funduszy nieruchomości we Francji
- 2.3. Fundusze nieruchomości w Polsce

Rozdział 3

Produkty strukturyzowane - Sławomir Olszewski

- 3.1. Istota produktów strukturyzowanych
- 3.2. Mechanizm funkcjonowania
- 3.3. Klasyfikacja produktów strukturyzowanych
 - 3.3.1. Rodzaj instrumentu bazowego
 - 3.3.2. Forma produktu
 - 3.3.3. Struktura kuponu
- 3.4. Geneza rynku produktów strukturyzowanych
- 3.5. Rynek produktów strukturyzowanych na świecie
- 3.6. Rynek produktów strukturyzowanych w Polsce

Rozdział 4

Sekurytyzacja i fundusze sekurytyzacyjne - Paweł Potoczek

- 4.1. Istota sekurytyzacji
- 4.2. Rodzaje papierów wartościowych w procesie sekurytyzacji
- 4.3. Zalety i wady transakcji sekurytyzacji
- 4.4. Rynek sekurytyzacji na świecie
- 4.5. Rynek sekurytyzacji i funduszy sekurytyzacyjnych w Polsce

Rozdział 5

Exchange Traded Funds (ETF) - Katarzyna Perez, Tomasz Miziołek

- 5.1. Istota ETF
- 5.2. Rynek ETF na świecie
- 5.3. Rynek funduszy ETF w Polsce
 - 5.3.1. Podstawy prawne funkcjonowania ETF w Polsce
 - 5.3.2. Pierwszy ETF na polskim rynku
 - 5.3.3. Czynniki rozwoju rynku ETF w Polsce

Rozdział 6

Zagraniczne fundusze inwestycyjne - Katarzyna Perez

- 6.1. Podstawy prawne funkcjonowania zagranicznych funduszy inwestycyjnych w Polsce
- 6.2. Oferta zagranicznych funduszy inwestycyjnych na polskim rynku
- 6.3. Rentowność funduszy zagranicznych
 - 6.3.1. Zagraniczne fundusze akcji
 - 6.3.2. Zagraniczne fundusze dłużne i pieniężne
 - 6.3.3. Zagraniczne fundusze hybrydowe
 - 6.3.4. Dochodowość funduszy zagranicznych i funduszy krajowych lokujących aktywa za granicą

Rozdział 7

Fundusze *hedge* - Marcei Mierzwicki

- 7.1. Definicja i istota funduszy *hedge*
- 7.2. Rodzaje funduszy *hedge*
- 7.3. Fundusze *hedge* na świecie
 - 7.3.1. Podstawy prawne funkcjonowania funduszy *hedge*
 - 7.3.1.1. Stany Zjednoczone
 - 7.3.1.2. Unia Europejska
 - 7.3.2. Rynek funduszy *hedge* na świecie
- 7.4. Fundusze hedgingowe w Polsce
 - 7.4.1. Podstawy prawne funkcjonowania funduszy *quasi-hedge* w Polsce
 - 7.4.2. Oferta funduszy *hedge* w Polsce

Rozdział 8

Islamskie fundusze inwestycyjne - Krzysztof Prałat, Piotr Krzemiński

- 8.1. Islamski system finansowy
 - 8.1.1. Fundamentalne zasady
 - 8.1.2. Instrumenty finansowania inwestycji
 - 8.1.2.1. Instrumenty określające współpracę jednostek na rynku
 - 8.1.2.2. Instrumenty wspólnego inwestowania - fundusze inwestycyjne.
 - 8.1.2.3. Instrumenty wspierające transakcje handlowe
 - 8.1.3. Historia i rozwój koncepcji bankowości bezodsetkowej
- 8.2. Koncepcja islamskich funduszy inwestycyjnych
- 8.3. Rynek islamskich funduszy inwestycyjnych
 - 8.3.1. Historia i rozwój rynku
 - 8.3.2. Rentowność funduszy islamskich

Rozdział 9

Procentowe instrumenty pochodne - Sławomir Antkiewicz

- 9.1. Rodzaje procentowych instrumentów pochodnych
- 9.2. Procentowe instrumenty pochodne w Polsce
 - 9.2.1. Możliwości inwestowania w procentowe instrumenty pochodne na GPW w Warszawie
 - 9.2.2. Możliwości inwestowania w derywaty procentowe na innych polskich rynkach regulowanych
 - 9.2.3. Pozagiełdowe instrumenty procentowe w Polsce
- 9.3. Możliwości inwestowania w pochodne procentowe na innych rynkach regionu Europy Środkowo-Wschodniej

Rozdział 10

Strategia *portfolio insurance* na rynku walutowym - Jacek Truszkowski

- 10.1. Istota i mechanizm działania strategii *portfolio insurance*
- 10.2. Przegląd literatury na temat *portfolio insurance*
- 10.3. Wykorzystanie strategii *portfolio insurance* w celu zabezpieczenia portfela przed ryzykiem walutowym
 - 10.3.1. Założenia i metodyka i badania
 - 10.3.2. Wyniki badania

Streszczenia rozdziałów w języku polskim

Summaries of chapters in English

Bibliografia