

Wprowadzenie 5

Rozdział 1

Teoretyczne podstawy ryzyka 7

1.1. Ryzyko w warunkach niepewności 7

1.2. Niepewność 11

1.3. Rodzaje prawdopodobieństwa 13

Rozdział 2

Klasyfikacja ryzyka 15

2.1. Typy i rodzaje ryzyka 15

2.2. Czynniki ryzyka

2.3. Gradacja ryzyka 24

Rozdział 3

Inwestycje w akcje w warunkach ryzyka rynkowego 27

3.1. Klasyczne metody analizy ryzyka 27

3.2. Normalność stóp zwrotu 41

3.3. Value at Risk jako element ograniczania ryzyka 50

3.4. Metodologia RiskGrades? 61

Rozdział 4

Fundamentalne koncepcje analizy ryzyka 79

4.1. Taksonomia rynku kapitałowego 79

4.2. Analiza aglomeracyjna 86

4.3. Wskaźniki syntetyczne w służbie wnioskowania 98

Wnioski 109

Spis rysunków 113

Spis tabel 115

Bibliografia 117