

Spis treści	
Wstęp.....	7

Rozdział 1

Rynek produktów strukturyzowanych w Polsce	11
---	-----------

Rozdział 2

Firmy prawne produktów strukturyzowanych	.23
2.1 Lokata bankowa	23
2.2. Bankowy papier wartościowy	25
2.3. Ubezpieczenie na życie i dożycie	27
2.4. Ubezpieczenie z ubezpieczeniowym funduszem kapitałowym	..29
2.5 Certyfikat inwestycyjny	30
2.6. Tytuł uczestnictwa w zagranicznym funduszu inwestycyjnym	34
2.7. Obligacja.....	36
2.8. Certyfikat strukturyzowany	38
2.9. Regulacje prawne związane z produktami strukturyzowanymi (MIFID)	39

Rozdział 3

Instrument o stałym dochodzie 43

3.1 Lokata bankowa	43
3.2. Bon skarbowy.	44
3.3. Obligacja.....	46
3.3.1. Model wyceny obligacji	
3.3.2. Stopy kasowe, terminowe i krzywa dochodowości	
3.3.3. Ryzyko inwestowania w obligacje	
3.3.4. Czas trwania i wypukłość obligacji	
3.3.5. Immunizacja (uodpornienie) portfela	

Rozdział 4

Instrument ryzykowny

4.1. Opcje.....	
4.2. Opcje egzotyczne	
4.2.1. Opcje złożone (compound options)	
4.2.2. Opcje barierowe (barrier op(ions)	
4.2.3. Opcje binarne (binary options)	
4.2.4. Opcje lookhack	
4.2.5. Opcje azjatyckie (asian options)	
4.2.6 Opcje antotall	
4.2.7. Opcje	
4.2.8. Opcje koszykowe (basket opttotts)	
4.2.9. Opcje tęczowe (rainbow options)	
4.2.10. Opcje mountain range	
4.3. Strategie opcyjne	
4.4. Wycena opcji..	
4.4.1. Uogólniony model Blacka-Scholesa-Mcrtona	
4.4.2. Modele analityczne dla wybranych opcji egzotycznych	
4.4.3. Metoda drzew dwumianowych	

44 4. Metoda Monte Carlo

4.4.5. Metoda Monte Carlo dla opcji na wiele aktywów

Rozdział 5

Konstrukcja produktów strukturyzowanych

Rozdział 6

Analiza wybranych produktów strukturyzowanych

6.1. Certyfikat depozytowy 6M FX EUR/PLN - umocnienie złotego

6.2. Grupowe Ubezpieczenie na życie z Ubezpieczeniowym

Funduszem Kapitałowym Agro Koszyk Plus II

6.3. Lokata strukturyzowana Liderzy Parkietu III

6.4. CU Gwarancja Globalne Inwestycje II '59

6.5. Obligacja WIG20 Profil

6.6. Obligacja WIG20 Premium

6.7. Obligacja Giganci Rynku

6.8. Certyfikat BZ WBK Nowa Era

6.9. Ubezpieczenie na życie i dożycie Mocca 178

Zakończenie.....

Bibliografia.....

—