
CUPRINS

Cuvânt înainte	9
Capitolul 1	
Funcțiile, organizarea și funcționarea pieței financiare în România	11
<i>Cuvinte-cheie</i>	14
<i>Teste grilă - întrebări</i>	15
<i>Aplicații rezolvate</i>	17
<i>Aplicații de rezolvat</i>	19
<i>Referințe bibliografice</i>	20
<i>Răspunsuri teste grilă – întrebări</i>	23
<i>Răspunsuri – aplicații de rezolvat</i>	23
<i>Scheme și grafice ppt.</i>	24
Capitolul 2	
Evaluarea activelor și decizia de investiții în mediu probabilistic	37
<i>Cuvinte-cheie</i>	41
<i>Teste grilă - întrebări</i>	41
<i>Aplicații rezolvate</i>	43
<i>Aplicații de rezolvat</i>	47
<i>Referințe bibliografice</i>	54
<i>Anexa 2.1.</i>	55
<i>Alte criterii de evaluare în mediu aleatoriu</i>	57
<i>Răspunsuri teste grilă – întrebări</i>	58
<i>Răspunsuri – aplicații de rezolvat</i>	58
<i>Scheme și grafice ppt.</i>	61
Capitolul 3	
Eficiența pieței financiare	71
<i>Cuvinte-cheie</i>	75
<i>Teste grilă – întrebări</i>	75
<i>Aplicații rezolvate</i>	78

<i>Aplicații de rezolvat</i>	82
<i>Referințe bibliografice</i>	84
<i>Răspunsuri teste grilă – întrebări</i>	85
<i>Răspunsuri – aplicații de rezolvat</i>	85
<i>Scheme și grafice ppt.</i>	86
<i>Aplicații în Excel</i>	92
Capitolul 4	
Titlurile financiare	93
<i>Cuvinte-cheie</i>	103
<i>Teste grilă – întrebări</i>	103
<i>Aplicații rezolvate</i>	106
<i>Studiu de caz</i>	112
<i>Aplicații de rezolvat</i>	113
<i>Referințe bibliografice</i>	117
<i>Răspunsuri teste grilă – întrebări</i>	118
<i>Răspunsuri – aplicații de rezolvat</i>	119
<i>Scheme și grafice ppt.</i>	120
Capitolul 5	
Rentabilitatea și riscul valorilor mobiliare	133
<i>Cuvinte-cheie</i>	136
<i>Teste grilă – întrebări</i>	136
<i>Aplicații rezolvate</i>	138
<i>Teste grilă – aplicații de rezolvat</i>	147
<i>Studii de caz propuse spre rezolvare</i>	149
<i>Referințe bibliografice</i>	150
<i>Răspunsuri teste grilă – întrebări</i>	151
<i>Răspunsuri – aplicații de rezolvat</i>	151
<i>Răspunsuri studii de caz propuse spre rezolvare</i>	151
<i>Scheme și grafice ppt.</i>	152
Capitolul 6	
Modelul de piață al rentabilității și riscului valorilor mobiliare	157
<i>Cuvinte-cheie</i>	161
<i>Teste grilă – întrebări</i>	162
<i>Aplicații rezolvate</i>	164
<i>Teste grilă – aplicații de rezolvat</i>	170
<i>Referințe bibliografice</i>	172
<i>Răspunsuri teste grilă – întrebări</i>	172
<i>Răspunsuri – aplicații de rezolvat</i>	173
<i>Scheme și grafice ppt.</i>	174

Capitolul 7

Indici bursieri	181
<i>Cuvinte-cheie</i>	184
<i>Teste grilă – întrebări</i>	184
<i>Aplicații rezolvate</i>	186
<i>Aplicații de rezolvat</i>	190
<i>Referințe bibliografice</i>	194
<i>Răspunsuri teste grilă – întrebări</i>	194
<i>Răspunsuri – aplicații de rezolvat</i>	194
<i>Scheme și grafice ppt.</i>	195

Capitolul 8

Rentabilitatea și riscul portofoliilor de valori mobiliare	207
<i>Cuvinte-cheie</i>	209
<i>Teste grilă – întrebări</i>	210
<i>Aplicații rezolvate</i>	212
<i>Aplicații de rezolvat</i>	215
<i>Referințe bibliografice</i>	219
<i>Răspunsuri teste grilă – întrebări</i>	219
<i>Răspunsuri – aplicații de rezolvat</i>	219
<i>Scheme și grafice ppt.</i>	220

Capitolul 9

Modelul Markowitz de diversificare a portofoliilor de valori mobiliare	225
<i>Cuvinte-cheie</i>	228
<i>Teste grilă – întrebări</i>	229
<i>Aplicații rezolvate</i>	230
<i>Aplicații de rezolvat</i>	234
<i>Referințe bibliografice</i>	238
<i>Răspunsuri teste grilă – întrebări</i>	238
<i>Răspunsuri – aplicații de rezolvat</i>	238
<i>Scheme și grafice ppt.</i>	239
<i>Aplicații în Excel</i>	246

Capitolul 10

Modelul CAPM și modelul APT	247
<i>Cuvinte-cheie</i>	250
<i>Teste grilă – întrebări</i>	250
<i>Aplicații rezolvate</i>	251
<i>Aplicații de rezolvat</i>	258

<i>Referințe bibliografice</i>	262
<i>Răspunsuri teste grilă – întrebări</i>	263
<i>Răspunsuri – aplicații de rezolvat</i>	263
<i>Scheme și grafice ppt.</i>	264
<i>Aplicații în Excel</i>	276

Capitolul 11

Piața și evaluarea opțiunilor	279
<i>Cuvinte-cheie</i>	289
<i>Teste grilă – întrebări</i>	289
<i>Aplicații rezolvate</i>	292
<i>Aplicații de rezolvat</i>	299
<i>Referințe bibliografice</i>	301
<i>Răspunsuri teste grilă – întrebări</i>	301
<i>Răspunsuri – aplicații de rezolvat</i>	301
<i>Anexa 11.1.</i>	302
<i>Anexa 11.2.</i>	303
<i>Scheme și grafice ppt.</i>	306

Capitolul 12

Contractele la termen ferm: FORWARDS, FUTURES și SWAPS	319
<i>Cuvinte-cheie</i>	324
<i>Teste grilă – întrebări</i>	325
<i>Aplicații rezolvate</i>	328
<i>Aplicații de rezolvat</i>	331
<i>Referințe bibliografice</i>	336
<i>Răspunsuri teste grilă – întrebări</i>	338
<i>Răspunsuri – aplicații de rezolvat</i>	338
<i>Anexa 12.1.</i>	339
<i>Anexa 12.2.</i>	340
<i>Scheme și grafice ppt.</i>	344