

CUPRINS

PARTEA I PROBLEME ȘI APLICAȚII

CAPITOLUL I

Valoarea banilor în timp..... 9

CAPITOLUL II

Concepte statistice: distribuția frecvențelor, histograma, tendința centrală, măsuri ale dispersiei, simetrie și asimetrie în distribuția randamentelor, kurtosis, distribuția normală, coeficientul de variație și rația Sharpe 15

CAPITOLUL III

Randamentul așteptat și riscul activelor individuale..... 23

CAPITOLUL IV

Utilitate și aversiune la risc 29

CAPITOLUL V

Randamentul și riscul portofoliilor de active; Teoria lui Markowitz; Diversificarea portofoliilor; Linia Alocării Capitalului (CAL)..... 31

CAPITOLUL VI

Modelul CAPM..... 47

CAPITOLUL VII

Modelul cu un singur indice și modele multifactoriale..... 63

CAPITOLUL VIII

Teoria arbitrajului de preț..... 77

PARTEA A II-A
REZOLVĂRI

Rezolvări Capitolul I.....	89
Rezolvări Capitolul II.....	95
Rezolvări Capitolul III	101
Rezolvări Capitolul IV	105
Rezolvări Capitolul V.....	107
Rezolvări Capitolul VI	115
Rezolvări Capitolul VII.....	119
Rezolvări Capitolul VIII.....	126
BIBLIOGRAFIE	133