

TEME PROPUSE PENTRU LUCRAREA DE DISERTAȚIE¹

Gestiunea portofoliului de proiecte – conf. univ. dr. Ciprian ALEXANDRU

1. Calculul riscului și rentabilității titlurilor și portofoliilor de titluri
2. Frontiera eficientă cu active riscante
3. Frontiera eficientă cu active fără risc
4. Aversiunea față de risc în constituirea unui portofoliu
5. Modelul de piață
6. Modelul de echilibru al activelor financiare
7. Modelul de arbitraj
8. Strategii de gestiune a portofoliilor
9. Metode de evaluare a performanței portofoliilor de titluri financiare
10. Managementul portofoliului de produse derivate

¹ Studenții pot propune și alte subiecte pentru tema lucrării de disertație, neincluse în lista de mai sus.