1 3+.08V

ACADEMIA DE STUDII ECONOMICE DIN MOLDOVA

IVAN LUCHIAN
AURELIA MARIANCIUC

MANAGEMENTUL PORTOFOLIULUI DE INVESTIȚII

Editura ASEM

II 37. 8 05

ACADEMIA DE STUDII ECONOMICE DIN MOLDOVA

Facultatea „Finanțe"

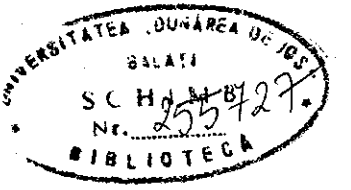
Catedra „Investiții și Piețe de Capital"

IVAN LUCHIAN
AURELIA MARIANCIUC

MANAGEMENTUL PORTOFOLIULUI DE INVESTIȚII

(sinteze, scheme, studii de caz)





Editura ASEM
Chișinău, 2007

CUPRINS

Prefață 4

Tema 1. **Portofoliul de investiții. Noțiuni generale** 5

Tema 2. **Profitabilitatea investițiilor în hârtii de valoare** 10
Studii de caz rezolvate 13
Studii de caz propuse 19

Tema 3. **Riscul investițional** 21
Studii de caz rezolvate 27
Studii de caz propuse 47

Tema 4. **Problema selectării portofoliului de investiții. Introducere în analiza portofoliului** 51
Studii de caz rezolvate 58
Studii de caz propuse 84

Tema 5. **Evaluarea obligațiunilor** 87
Studii de caz rezolvate 91
Studii de caz propuse 113

Tema 6. **Evaluarea acțiunilor simple** 118
Studii de caz rezolvate 121
Studii de caz propuse 128

Tema 7. **Gestiunea portofoliului obligațiunilor** 132

Tema 8. **Gestiunea portofoliului de acțiuni** 136

Tema 9. **Analiza fundamentală** 140
Studii de caz rezolvate 144
Studii de caz propuse 146

Tema 10. **Analiza tehnică a pieței valorilor mobiliare** 149

Tema 11.**Gestiunea portofoliului de investiții** 160

Tema 12. **Evaluarea eficienței gestiunii portofoliului** 166