

TEME PENTRU LUCRĂRI DE DISERTAȚIE

conf. univ. dr. ADRIAN NIȚU

Program de studiu:

FINANȚE CORPORATIVE

Discipline :

Evaluare de active și afaceri, Investiții financiare, Gestiune de portofoliu

1. Politici de finanțare a operatorilor economici. Studiu de caz
2. Decizia de finanțare a operatorilor economici. Studiu de caz.
3. Analiza surselor de finanțare disponibile pentru o firmă. Studiu de caz.
4. Finanțarea prin fonduri europene a operatorilor economici. Studiu de caz.
5. Finanțare directă și finanțare indirectă a unei companii. Studiu de caz.
6. Finanțarea unei companii prin emisiune de acțiuni. Aplicații.
7. Finanțare unei firme prin emisiune de obligațiuni. Aplicații.
8. Instituții de intermediere financiară. Analiza unei companii multinaționale.
9. Analiza unui proces de preluare a unei companii. Studiu de caz.
10. Levierul operațional ca măsură a riscului investițional. Aplicații.
11. Pragul de rentabilitate. Studiu de caz.
12. Marja de siguranță financiară. Studiu de caz.
13. Analiza de senzitivitate în cazul unui proiect investițional. Aplicații.
14. Analiza costului capitalului la un operator economic cu acțiuni cotate la bursă, finanțat prin emisiune de obligațiuni și prin credit pe termen lung. Studiu de caz.
15. Portofolii de titluri financiare. Analiza rentabilității estimate și a riscului. Aplicații.
16. Analiza setului fezabil prin compunerea în proporții diferite a două acțiuni într-un portofoliu. Studiu de caz.
17. Linia caracteristică a acțiunii. Coeficientul beta. Aplicații.
18. Dreapta de piață a acțiunii. Influența inflației, a riscului de firmă, a aversiunii la risc și a riscului internațional asupra echilibrului pieței de capital. Aplicații.
19. Deviația standard și coeficientul de variație. Studiu asupra unui eșantion format din 10 acțiuni listate BVB.
20. Analiza unui portofoliu format din 3 acțiuni selecționate dintr-un coș de 10 acțiuni. Rata de rentabilitate și riscul portofoliului în funcție de coeficientul de corelație.
21. Rentabilitatea estimată și deviația standard a unui portofoliu format din două acțiuni A și B pentru factori de corelație și proporții diferite.
22. Setul fezabil și frontiera eficientă pentru un portofoliu format din 2 acțiuni.
23. CAPM. Dreapta pieței de capital. Studiu de caz.
24. Linia caracteristică a acțiunii. Determinarea coeficientului beta. Exemplificare pe 3 acțiuni.
25. Dreapta de piață a acțiunii. Exemplificare pentru trei acțiuni pe o piață cu rata fără risc și rentabilitatea pieței definite.
26. Determinarea coeficientului beta pentru un număr de 5 acțiuni cotate la BVB.
27. Impactul inflației asupra dreptei de piață a acțiunii. Studiu de caz.
28. Influența gradului de aversiune la risc a investitorilor asupra dreptei de piață a acțiunii. Studiu de caz.
29. Impactul modificării beta și a riscului de țară asupra dreptei de piață a acțiunii. Studiu de

caz.
30. Fonduri de investiții. Analiza cotațiilor titlurilor de participare la un fond deschis de investiții din România.
31. Fonduri de investiții. Valoarea unitară a activului net. Studiu de caz.
32. Managementul de portofoliu. Managementul activ și managementul pasiv.
33. Titluri de participare la organisme de plasament colectiv. Emisiune. răscumpărare. Studiu de caz.
34. Analiza comparativă între două fonduri deschise din România.
35. Fonduri închise de investiții. Cazul SIF-urilor în România.
36. Acțiunile SIF-urilor. Determinarea primelor sau a discounturilor pentru cursul lor în ultimii trei ani.
37. Firme de intermediere pe piața de capital. SSIF-uri. Studiu de caz.