

Tema 5: Analiza factorială a cursului bursier al acțiunilor unei bănci derivată din modelul imunizării bazate pe durată

1. Alegeți o bancă de pe piața românească sau de pe piața internațională cotate la bursă;
2. Colectați date cu privire la bilanțul sintetic al acestei bănci pe o perioadă determinată (date trimestriale, semestriale sau anuale) pe o perioadă suficient de relevantă (să aveți un minim de înregistrări prin care să puteți testa regresia);
3. Colectați date cu privire la prețul bursier al acțiunilor acestei bănci;
4. Testați factorii care influențează modificarea prețului la bursă a acțiunilor unei bănci derivați din modelul imunizării bazate pe durată.