

ANALIZA FUNDAMENTALĂ A INVESTIȚIEI DE CAPITAL ÎN EXCHANGE-TRADED FUND

Alina-Cristina Racu ^{1*}

Academia de Studii Economice, București, România

Rezumat

Creșterea în popularitate a pieței de exchange traded-funds necesită analiza aprofundată a anumitor aspecte, astfel încât să se poată realiza o bună investiție. Acest articol are ca scop prezentarea conceptelor ce țin de performanța unui ETF, dar și principalii factori ce o influențează.

În acest sens, am rulat mai multe regresii în E-views și am analizat rezultatele acestora pentru a putea concluziona care sunt aspectele de luat în considerare atunci când un investitor decide să achiziționeze unități dintr-un ETF. Factori precum lichiditatea, volumul tranșat sau riscul unui ETF, reprezintă variabile importante de analizat.

Cuvinte-cheie: ETF, eroare de replicare, strategie pasivă, piața de capital, investiția de capital, investitori individuali.

Clasificare JEL: G11, G23

¹ Autor de contact, **Racu Alina-Cristina** – racu_alinacristina@yahoo.com