

**Propuneri de teme pentru programul de masterat CERCETĂRI AVANSATE ÎN FINANȚE**  
**Anul universitar 2021-2022**

<b>DEPARTAMENTUL DE FINANȚE</b>	
	<b>Cadru didactic: PROF.UNIV.DR. MITRICĂ NELU EUGEN</b>
	<b>Contact: nelu.mitrica@fin.ase.ro</b>
	<b>Consiliere: e-mail instituțional</b>
Nr crt	Tema
1	Mixul de politici și echilibrului economic general
2	Corelațiile echilibrului financiar cu celelalte componente ale echilibrului economic general
3	Eficiența piețelor financiare – testarea eficienței informaționale
4	Piata de capital sub efectul politicii monetare neconventionale

**DEPARTAMENTUL MONEDĂ ȘI BĂNCI**

<b>Prof. dr. MOINESCU BOGDAN GABRIEL</b>	1. Model simplificat de cuantificare a probabilității de nerambursare 2. Model simplificat de cuantificare a pierderii în caz de nerambursare 3. Model econometric simplificat pentru estimarea curbei randamentelor titlurilor de stat 4. Cuantificarea riscului operațional prin metoda indicatorilor cheie 5. Sisteme de avertizare timpurie a deteriorării performanțelor instituțiilor de credit/instituțiilor financiare nebancale 6. Evaluarea rezilienței bancare la condiții economice extreme, dar plauzibile 7. Metode de evaluare a lichidității la risc 8. Rolul politicii prudențiale în cadrul mix-ului de politici economice 9. Evaluarea interacțiunii dintre sistemul financiar și economia reală 10. Stabilitatea financiară versus stabilitatea monetară 11. Administrarea tandemului risc suveran - fragilitate bancară <b>Contact: bogdan.moinescu@fin.ase.ro</b> <b>Consiliere: email instituțional/ zoom</b>
<b>Prof.dr. NEGREA BOGDAN CRISTIAN</b>	1. Modele avansate de evaluare a opțiunilor europene 2. Evaluarea opțiunilor americane 3. Opțiuni financiare exotice 4. Volatilitatea activelor financiare 5. Volatilitate implicită și smile de volatilitate 6. Limitele arbitrajului financiar 7. Crizele financiare 8. Lichiditatea piețelor financiare 9. Comparăție între microstructurile piețelor financiare 10. Formarea prețurilor și concurența pe piața financiară 11. Asimetria de informații și eficiența informațională a pieței financiare 12. Modele avansate de gestiune a portofoliilor de titluri financiare 13. Mecanisme de transmisie a politicii monetare 14. Riscul de credit 15. Evaluarea obligațiunilor corporatiste 16. Hedging dinamic

17. Procese haotice în finanțe

18. Modelarea riscurilor financiare extreme

**Contact: bogdan.negrea@fin.ase.ro**

**Consiliere: email instituțional**