

Propuneri de teme pentru programul de masterat **TEHNICI ACTUARIALE
Anul universitar 2021-2022**

DEPARTAMENTUL DE FINANȚE	
	Cadru didactic: Prof.univ.dr. ARMEANU Daniel
	Contact: stefan.armeanu@fin.ase.ro
	Consiliere: e-mail institutional
Nr. Crt.	Tema
1	Testarea eficienței pieței de capital în România
2	Analiza asimetriei de informații în gestiunea portofoliului
3	Optimizarea portofoliului de active financiare pe piețele internaționale
4	Utilizarea modelelor de analiză a datelor pe piața de capital din România
5	Aplicarea tehnicilor de analiză fundamentală aprofundată pe piața de capital din România
6	Analiza riscului portofoliului de active financiare pe baza metodologiei var (value
7	Gestionarea eficientă a portofoliului de investiții al societăților de asigurări
8	Modalități de acoperire a riscurilor investițiilor financiare
9	Instrumente și strategii de optimizare a portofoliilor de obligațiuni pe piețele internaționale
10	Fundamentarea deciziei de investiție pe piața de capital
11	Evaluarea riscurilor și a performanțelor portofoliilor de active financiare
12	Gestionarea optimă a portofoliilor financiare supuse restricțiilor de investiție
	Cadru didactic: conf.univ.dr. CRISTESCU AMALIA FLORINA
	Contact:amalia.cristescu@economie.ase.ro
	Consiliere: e-mail institutional
Nr. Crt.	Tema
1	Analiza stabilității financiare a sectorului bancar din România.
2	Risc, incertitudine și politică monetară în UE.
3	Structuri de piață și comportamentul firmei. Studiu de caz.
4	Comportamentul consumatorilor români – între legea psihologică a lui Keynes și “animal spirit”.
5	Strategii de preț pe piața de monopol/oligopol. Studiu de caz.
6	Concurența în sectorul asigurărilor – indicatori specifici. Studiu de caz.
7	Structura piețelor și adaptarea comportamentului firmelor. Studiu de caz.
8	Iraționalitatea consumatorului ca factor de progres economic
9	Efectele integrării comerciale și financiare a României cu țările zonei euro.
10	Impactul îmbătrânirii populației asupra sustenabilității finanțelor publice în UE. Reforma sistemelor de pensii
11	Efectele consolidării fiscale asupra datoriilor suverane din zona euro
12	Rolul piețelor financiare în declanșarea crizei. Eficiență sau eșec?
13	Eficiența politicii fiscale în contextul crizei economice. Consolidare fiscală versus creștere economică
14	Analiza mixului de politici monetare și fiscal - bugetare în zona euro.
15	Coordonarea politicilor în cadrul Uniunii Economice și Monetare
	Cadru didactic: Conf.univ.dr. Cristina Fulga

	Contact: fulga@csie.ase.ro
	Consiliere: e-mail institutional
Nr. Crt.	Tema
1	Behavioral Finance in portfolio investment decisions
2	Decision making under uncertainty and Cumulative Prospect Theory
	Cadru didactic: Conf. univ. dr. Mihaela COVRIG
	Contact: mihaela.covrig@csie.ase.ro
	Consiliere: e-mail institutional
Nr. Crt.	Tema
1	Reînnoirea unei polițe de asigurări CASCO: factori determinanți;
2	Estimarea primei nete a unei asigurări de tip CASCO;
3	Aplicații ale modelelor de regresie logistică în asigurările de viață;
4	Aplicații ale modelelor de regresie logistică în asigurările generale;
5	Posibile propuneri ale masteranzilor.
	Cadru didactic: Lect. univ. MIRCEA Iulian
	Contact: iulian.mircea@csie.ase.ro
	Consiliere: e-mail institutional
Nr. Crt.	Tema
1	Ierarhizarea proiectelor de investiții financiare folosind agregarea informațiilor vagi.
2	Planuri de pensie: perspective tehnice și financiare.
3	Utilizarea mulțimilor vagi în managementul unui portofoliu de riscuri.
4	Asupra legăturii dintre beneficii și performanța investițiilor în asigurările de viață.
5	Abordări privind previziuni asupra mortalității.
6	Modelarea matematică a duratei de viață.
	Cadru didactic: Prof.univ.dr. Bogdan Iftimie
	Contact: bogdan.iftimie@csie.ase.ro
	Consiliere: e-mail institutional
Nr. Crt.	Tema
1	Modele agregate de pierdere.
2	Procese Markov in timp discret utilizate in asigurari.
3	Modelarea dependentei in modele multidimensionale cu ajutorul copulelor.
4	Metode statistice de calibrare pentru modelele de pierdere.
5	Studiu privind Teoria Valorilor Extreme prin considerarea pierderii maxime.
6	Studiu privind Teoria Valorilor Extreme prin considerarea pierderilor ce depasesc un anumit nivel semnificativ.
7	Studiu comparativ privind alegerea unui model optim de modelare a pierderilor.
8	Teste statistice de concordanta aplicate pentru modele de pierdere.
9	Estimarea parametrilor pentru repartitiile ce modeleaza valorile extreme.
10	Masuri de risc pentru diverse repartitii ce modeleaza severitatea pierderilor.
	Cadru didactic: Conf.univ.dr. Laura Elly NAGHI
	Contact: laura.naghi@fin.ase.ro,
	Consiliere: e-mail institutional
Nr. Crt.	Tema
1	Impactul Solvency II asupra capitalizarii companiilor de asigurari din Romania

2	Aspecte legislative si actuariale din asigurarile private de sanatate
3	Modificări ale legislației asupra raportărilor întocmite de actuari
4	Realizarea raportărilor pentru activitatea de reasigurare
5	Guvernanța corporativă la nivelul companiilor de asigurări
6	Analiza de scenarii în cadrul unei companii de asigurări