

PROGRAM MASTERAT- CEFIN

(tematica aste valabilă doar pentru pentru absolvenții care nu au susținut examenul de finalizare)

Prof. dr. MOINESCU BOGDAN GABRIEL	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 nebankare
	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
	Contact: bogdan.moinescu@fin.ase.ro
Prof.dr. NEGREA BOGDAN CRISTIAN	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. Comparație 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	

DEPARTAMENTUL DE FINANȚE	
Propuneri de teme pentru programul de masterat	
Cercetări Avansate în Finanțe	
Anul universitar 2022-2023	
DOAR PENTRU ABSOLVENȚII CARE NU AU SUSȚINUT EXAMENUL DE DISERTAȚIE	
	Cadru didactic: PROF.UNIV.DR. MITRICĂ NELU EUGEN
	Contact: nelu.mitrica@fin.ase.ro
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
	Cadru didactic: Conf.univ.dr. MITROI Adrian
	Contact: adrian.mitroi@fin.ase.ro
Nr crt	Tema
1	Optimizarea alocării activelor portofoliului de investiții individuale. Bursele bear vs. bull
2	Aplicarea analizei fundamentale și comportamentale în evaluarea investițiilor pentru portofoliul individual. Administrarea riscului vs administrarea rentabilității investiționale
3	Alocarea activelor în portofoliul investițional în funcție de aversiunea la risc a investitorului
4	Analiza riscului portofoliului de active financiare individuale. Riscul de comportament
5	Portofolii diversificate și optimizate pe clase de active. Alocarea activelor vs. selectarea titlurilor în administrarea investițiilor cu regulile de disciplină financiară comportamentală
6	Administrarea corelată a activelor și pasivelor , analize statistice cu aplicabilitate practică despre corelații și cauzalități între managementul activ și performanța investițională
8	Cele 3 Premii Nobel recente în Finanțele Comportamentale. Aplicabilitate practică. Cercetări empirice curente și de viitor. Dezvoltări în domeniul Finanțelor Comportamentale.