

Facultatea Finanțe, Asigurări, Bănci și Burse de Valori

Departamentul de Finanțe

Tematică și bibliografie concurs

Post 72 Asistent de cercetare științifică

Tematică:

1. Modelul regresiei simple.
 - Metoda celor mai mici pătrate. Mod de obținere, mecanism, proprietăți algebrice, goodness-of-fit
 - Unități de măsură și forme funcționale
 - Încorporarea nonliniarităților în regresia liniară
 - Estimatorii OLS. Medie și varianță, estimatori unbiased, estimatori eficienți, varianța erorii
 - Estimarea CAPM
2. Modelul de regresie multiplă
 - Model cu 2 variabile independente. Model cu k variabile independente
 - Variabile irelevante și biais-ul variabilelor omise
 - Obținerea estimatorilor OLS. Medie, varianță, varianța erorii.
 - Multicoliniaritatea
3. Inferență statistică și OLS
 - Testul t-student și testul F
 - Calcularea p-value
 - Intervale de încredere
4. Regresii cu variabile dummy
 - Descrierea informației calitative
 - Interpretarea coeficienților
 - Folosirea variabilelor dummy pentru categorii multiple
5. Heteroscedasticitate și autocorelații în rezidurile în regresie
 - Caracteristici și implicații
 - Teste statistice
6. Regresii în panel.
 - Estimare cu pooled cross sections.
 - Estimare cu efecte fixe. Variabile dummy în regresie. Efecte fixe cu panel unbalanced
 - Estimare cu efecte aleatoare.
 - Efecte fixe sau efecte aleatoare?
7. Procese staționare ARMA
 - Staționaritate. Zgomot alb
 - Procese MA. Procese AR
 - Procese ARMA și ARIMA

- Forecasting
- 8. Stakeholderii companiei. Teoria de agent
- 9. Structura capitalului
- 10. Politica de dividend
- 11. Guvernanța corporativă
- 12. Eficiența pieței de capital
- 13. Bune practici în cercetare

Bibliografie:

Brooks, C., *Introductory Econometrics for Finance*, Second edition, Cambridge University Press, 2008, Capitolele 1-5, Capitolul 10, <https://studylib.net/doc/25672684/introductory-econometrics-for-finance-by-chris-brooks>

Brooks, C.; Schopol, L., *Topics and trends in finance research: What is published, who publishes it and what gets cited?*, *The British Accounting Review* 50 (2018), pp. 615-637, <https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S0890838918300180>

Cargill, M.; O'Connor, P., *Writing Scientific Research Articles*, Wiley Blackwell, 2009, https://rauterberg.employee.id.tue.nl/lecturenotes/2009-Writing_Scientific_Research_Articles.pdf

Dragotă, V; Obreja Brașoveanu, L.; Dragotă, IM, *Management financiar*, ediția a doua, volumul I, *Diagnosticul financiar al companiei*, Editura Economică, 2012, cap 1

Dragotă, V; Obreja Brașoveanu, L.; Dragotă, IM, *Management financiar*, ediția a doua, volumul II, *managementul financiar strategic*, Editura Economică, 2016, cap 2, 9, 10

Obreja Brașoveanu L. (coordonator) – *Piața de capital*, Ed. ASE, București, 2011, cap 8

Hamermesh, D., *The Young Economist's Guide to Professional Etiquette*, *Journal of Economic Perspectives*, Vol.6, No.1, pp.169-179, http://www.unice.fr/sg/resources/docs/Hamermesh_A%20Young%20Economist's%20Guide%20to%20Professional%20Etiquette.pdf

Kallestinova, E., *How to Write Your First Research Paper*, *Yale Journal of Biology and Medicine* 84 (2011), pp.181-190, https://poorvucenter.yale.edu/sites/default/files/files/how_to_write_your_first_research_paper_2011.pdf

Paul, J.; Criado, A.R., *The art of writing literature review: What do we know and what do we need to know?*, *International Business Review*, Vol.29, Issue 4, 2020

Reinartz, S.; Urban, D., *Finance conference quality and publication success: A conference ranking*, *Journal of Empirical Finance* 42 (2017), pp.155-174, <https://daneshyari.com/article/preview/5100281.pdf>

Wooldridge J., *Introductory Econometrics. A Modern Approach*, Fifth Edition, South-Western Cengage Learning, 2009, Capitolele 1-14, https://economics.ut.ac.ir/documents/3030266/14100645/Jeffrey_M._Wooldridge_Introductory_Econometrics_A_Modern_Approach_2012.pdf