

## Facultatea Finanțe, Asigurări, Bănci și Burse de Valori

### Departamentul de Finanțe

#### Tematică și bibliografie concurs

#### Post 73 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. Piața financiară
- 9. Piața bunurilor și piața financiară: modelul *IS-LM*
- 10. Modelul *IS-LM* într-o economie deschisă
- 11. Piața financiară și așteptările
- 12. Studiu de caz: Marea Criză Financiară 2007-2010
- 13. Bune practici în cercetare

### **Bibliografie:**

Blanchard, O.; Amighini, A.; Giavazzi, F., *Macroeconomics: A European Perspective*, Pearson Education Limited, 2010, [https://faculty.ksu.edu.sa/sites/default/files/macroeconomics\\_olivier\\_blanchard.pdf](https://faculty.ksu.edu.sa/sites/default/files/macroeconomics_olivier_blanchard.pdf)

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](https://rauterberg.employee.id.tue.nl/lecturenotes/2009-Writing_Scientific_Research_Articles.pdf)

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](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](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](https://economics.ut.ac.ir/documents/3030266/14100645/Jeffrey_M._Wooldridge_Introductory_Econometrics_A_Modern_Approach_2012.pdf)