

Facultatea Finanțe, Asigurări, Bănci și Burse de Valori

Departamentul Monedă și Bănci

**Tematica și bibliografia postului de asistent universitar pe perioadă nedeterminată scos la concurs
pentru semestrul II al anului universitar 2024-2025**

Postul 31 Asistent universitar dr.

Discipline: Modelarea deciziei financiar-monetare, Inginerie financiară

Tematica

1. Problema statică de optim a consumatorului. Formularea problemei de maximizare a utilității.
2. Funcții de cerere de tip Marshall. Funcția de utilitate indirectă. Funcții de cerere de tip Hicks. Funcția de cheltuieli minime.
3. Problema dinamică de optim a consumatorului.
4. Funcția de producție. Problema de optim a producătorului.
5. Analiza interacțiunii pe termen scurt dintre sectorul real și sectorul financiar într-o economie închisă prin intermediul modelelor de tip IS-LM.
6. Analiza interacțiunii pe termen scurt dintre sectorul real și sectorul financiar într-o economie mică deschisă prin intermediul modelelor de tip Mundell-Fleming.
7. Rentabilitatea, rentabilitatea așteptată și riscul unui portofoliu de active financiare. Ecuațiile unui portofoliu. Portofolii cu 2 active cu risc. Portofoliul de risc minim.
8. Portofolii eficiente formate din active cu risc. Problema de minimizare a riscului unui portofoliu. Frontiera Markowitz.
9. Modelul CAPM de evaluare a activelor financiare.
10. Relații uzuale de arbitraj financiar. Limite ale opțiunilor „plain-vanilla” europene. Evaluarea contractelor futures.
11. Modelul Black-Scholes-Merton.
12. Indicatori de senzitivitate. Strategii de hedging static și dinamic bazate pe utilizarea instrumentelor financiare derivate.
13. Modelul Garman-Kohlhagen
14. Modelul Black
15. Modelul Merton pentru evaluarea riscului de credit.

Bibliografie

1. Altar, M., Teoria portofoliului, note de curs, 2002,
<http://www.dofin.ase.ro/Lectures/Altar%20Moisa/Teoria%20portofoliului.pdf>
2. Altar, M., Necula, C., Bobeica, G., Modelarea deciziei financiar-monetare, note de curs, 2009,

<http://www.dofin.ase.ro>

3. Bodie, Z., Kane, A., Marcus, A.J., Investments, ed. 6, McGraw-Hill, 2005
4. Mishkin, F., The economics of money, banking, and financial markets, ed. 8, Addison-Wesley, 2007
5. Mankiw, N.G., Macroeconomics, ed. 6, Worth Publishers, 2008
6. Reilly, F.K., Brown, K.C., Investment analysis and portfolio management, ed. 8, Thomson, 2006
7. Varian, H.R., Microeconomic Analysis, ed. 3, Norton & Company, 1992
8. Varian, H.R., Intermediate microeconomics: a modern approach, ed. 8, W.W. Norton & Company, 2010
9. Negrea B., Damian V., Calcul stocastic aplicat în inginerie financiară, Economică, București, 2015
10. Negrea B., Evaluarea activelor financiare. O introducere in teoria proceselor stocastice aplicate in finanțe, Economică, București, 2006