



Universitatea Spiru Haret

Facultatea de Stiinte Juridice, Economice si Administrative, Craiova

Programul de master: Finante si Administratie publica europeana

Propunere teme referat

Disciplina *Gestiunea riscului financiar*

Titular disciplin : Conf. univ. dr. Laura Ungureanu

1. Riscul în opera iunile financiare
2. Analiza cost – volum - profit în condi ii de risc
3. Investi ii de capital în condi ii de risc
4. Modele probabiliste pentru investi iile de capital
5. Managementul riscului in afaceri
6. Managementul riscului in investitiile internationale
7. Studiul factorilor determinan i ai riscului pentru întreprinderile din sectorul de activitate.....
8. Cuantificarea riscului în evaluarea întreprinderilor
9. Risc i contagiune – crizele financiare i diversificarea interna ional a riscului
10. Expunerea la risc a pie elor de capital: analiz comparativ a pie elor dezvoltate i a pie elor emergente
11. Factori macroeconomici de influen asupra performan elor pie elor de capital (pie e dezvoltate, pie e emergente)
12. Factori locali, regionali i globali de influen asupra randamentelor pe piața de capital
13. Impactul riscului valutar asupra performan elor investi iilor interna ionale
14. Modelarea relației dintre cursul de schimb i piața de capital
15. Risc i instabilitatea financiar
16. Expunerea la risc valutar a companiilor non-financiare
17. Gestionarea riscurilor in creditare.
18. Solu ii informatice destinate managementului riscurilo
19. Diversificarea riscurilor bancare i minimizarea pierderilor determinate de acestea.
20. Metode i tehnici de evaluare a riscurilor i impactul lor asupra b ncilor.
21. Riscurile în procesul credit rii i gestionarea lor.
22. Riscul valutar i metode de gestionare a acestuia.
23. Rolul i func iile instrumentelor derivate în acoperirea riscurilor.
24. Identificarea riscului de rat a dobânzii i modalit i de gestionare a acestuia. \
25. Componentele riscului opera ional i modul de gestionare a acestuia.
26. Gestionarea pozi iei monetare i a pozi iei lichidit ii b ncilor.
27. Riscul de banc . Criterii de evaluare. Indicatori i factori lua i în calculul riscului de banc
28. Modalit i de eficientizare a managementului riscului de rat a dobânzii.
29. Modalit i de eficientizare a managementului riscului de creditare. .
30. Modele de supraveghere financiar pruden ional .

NOTA:

Formulara temelor nu este limitativa. Masteranzii pot veni cu propuneri de teme, altele decat cele enuntate.

Bibliografie:

1. Armeanu, St. D.; Stancu, I.- *Evaluarea riscului activitatii financiare cu aplicatii pe economia româneasca*, Bucuresti , A.S.E, 2005
2. Bârsan, N., Popescu I. - *Managementul riscului. Concepte, metode, aplica ii*, Editura Universit ii „Transilvania" din Bra ov 2003

3. Cocea, M – *Evaluarea riscurilor – Metode și tehnici de analiză la nivel micro și macroeconomic*, Ed. Lux Libris, Brașov, 2003
4. Druic, E. - *Economia Riscului, Teorie și Aplicații*, Editura Cartea Studențescă, 2008
5. Isaac-Maniu, I., - *MSurarea și analiza statistică a riscului în România*,
6. Mărcine, V., - *Decizii manageriale, îmbunătățirea performanțelor decizionale ale firmei*, Editura Economică, București, 1998
7. Pripoiaie, R – *Analiza și prognoza statistică a riscului de faliment al firmei*, E.D.P., București, 2004
8. Popescu I., Ungureanu L - *Decizia sau demersul antientropic de la cauza la efect*, Ed. Universității Lucian Blaga, Sibiu, 2005;
9. Popescu I., Ungureanu L - *Stiința conducerii - valori, tendințe, perspective*, vol. II, Ed. Universității Lucian Blaga, Sibiu, 2004;
10. Stancu S., Mihail N. – *Decizii economice în condiții de incertitudine*, Editura Economică, București, 2005
11. Stoina .N. – *Risc și incertitudine în investiții*, Editura Teora, București, 2008
12. Ungureanu L. – *Gestiunea riscului financiar*, Editura REVERS, Craiova, 2015