

TEME PENTRU LUCRĂRI DE LICENȚĂ

conf.univ.dr.ADRIAN NIȚU

Piețe de capital

1. Investitorii instituționali și rolul lor pe piața de capital. Aplicații: fondurile mutuale, fondurile de pensii etc.
2. Structura și funcționarea fondurilor de investiții în România
3. Managementul de portofoliu la fondurile de investitii.
4. Hedge-fonduri pe piata financiara internationala
5. Modele de analiza de portofoliu pentru piața de capital din Romania
6. Analiza fundamentală pe piața acțiunilor.
7. Analiza fundamentală pentru selecția de portofoliu pe piața bursieră BVB
8. Calculul frontierei de eficiență pentru un portofoliu de 5 acțiuni cotate la BVB
9. Utilizarea indicatorului si funcției Omega pentru analiza de portofoliu.
10. Analiza si selectia de portofoliu prin metode de analiza a rentabilitatii ajustate cu riscul
11. Analiza de portofoliu utilizând metode ale Teoriei Post Moderne de Portofoliu.
12. Rolul organismelor de plasament colectiv în economie; fondurile deschise/închise).
13. Evaluarea performanțelor fondurilor de investituii pe piața de capital din Romania

Relații monetar financiare internaționale

1. Rolul Fondului Monetar internațional în finanțarea balanței de plăți externe.
2. Globalizarea piețelor financiare: factori, tendințe, efecte, probleme.
3. Integrarea piețelor de capital în UE: analiza, evolutii recente, tendinte
4. Evoluția sistemului monetar - financiar internațional și rolul său asupra dezvoltării economiilor moderne.

5. Programele FMI de macrostabilizare economică și finanțarea deficitului de cont curent. Cazul României.
6. Balanța de plăți externe și poziția investițională internațională.
7. Politicile de echilibrare a balanței de plăți. Finanțarea deficitului de cont curent. Cazul României.
8. Datoria externă și nivelul optim de îndatorare. Gestionarea datoriei externe. Datoria externă a României.
9. Finanțarea prin Banca Europeană pentru Reconstrucție și Dezvoltare. Proiectele BERD în România.
10. Finanțarea afacerilor internaționale - rolul investițiilor de portofoliu.
11. Capacitatea de îndatorare și structura optimă a datoriei externe.
12. Evaluarea riscului de împrumut pe piețele de capital. Rolul agențiilor de rating.
13. Plățile internaționale. Instrumente de plată și credit. Modalități de plată internaționale: acreditivul documentar, incasoo documentar și garanțiile bancare - abordare comparativă.
14. Tehnica creditării bancare. Rapoarte de analiză și interpretarea situațiilor financiare. Contractul de credit și evaluarea unei cereri de credit. Studiu de caz.
15. Analiză comparativă a investițiilor străine directe și a investițiilor de portofoliu.
16. Fondurile de pensii ca investitori instituționali. Reglementarea fondurilor de pensii în România.
17. Investițiile străine și rolul acestora în economie. Cazul României.
18. Contractul de vânzare cumpărare internațională.
19. Guvernarea societăților comerciale (corporate governance) experiențe naționale, probleme, tendințe.
20. Finanțarea pe termen mediu și lung a exporturilor: creditul furnizor și creditul cumpărător. Studiu de caz.
21. Tehnica finanțării prin forfetare și factoring a comerțului internațional. Studiu de caz.
22. Bursa de energie și materii prime – loc de confruntare dintre marile puteri.
23. Riscul de preț: clauze contractuale de acoperire a riscului.
24. Riscul valutar: clauze contractuale de acoperire a riscului.

25. Eficiența utilizării acreditivului ca mijloc de plată în tranzacții internaționale. Studiu de caz la Raiffeisen Bank.

Burse de valori

1. Bursa de Valori București și indicii de bursă BET și BET-C
2. Introducerea acțiunilor la cota bursei: motivații, mecanisme.
3. Proceduri de cotare folosite la bursele de valori. Bursa din Frankfurt și Tokio. Comparatie
4. Rolul bursei de valori în economia reală. Experiența BVB în emisiunea de acțiuni.
5. Organizarea și funcționarea societăților de servicii de investiții financiare.(Studiu de caz).
6. Finanțarea prin emisiune publică de acțiuni (IPO). Piața primară și secundară a acțiunilor. Studiu de caz.
7. Emisiunea de acțiuni. Acțiunile internaționale.
8. Emisiunea de obligațiuni. Obligațiunile internaționale.
9. Mecanismul de tranzacții bursiere cash/în marjă.
10. Analiza chartista. Studiu de caz pentru acțiuni tranzacționate la BVB.
11. Bursa de Valori București. Analiza indicatorilor de lichiditate și financiare pentru 5 titluri cotate.
12. Strategia operațiunilor SWAP. Swap-ul valutar, de dobândă și pe piața de capital.
13. Tranzacții cu contracte futures și cu opțiuni la BMFM Sibiu.
14. Hedging în comerțul internațional cu metale neferoase.Studiu de caz la LME.
15. Tranzacții complexe cu opțiuni.
16. Strategii de tranzacții cu contracte Repo și reverse Repo pe piața românească.
17. Strategii de acoperire a riscurilor valutare pe piețe la termen.
18. Operațiunile de acoperire a riscului de preț pe piețele la termen (forward și futures): hedging de vânzare/cupărare.
19. Operațiunile cu opțiuni: definire, rol în acoperirea riscului de preț/valutar.
20. Metode de evaluare a opțiunilor.