



ROMÂNIA  
UNIVERSITATEA BABEȘ-BOLYAI CLUJ-NAPOCA

Str. Mihail Kogălniceanu, nr. 1, 400084 Cluj-Napoca  
Tel. (00) 40 - 264 - 40.53.00\*; 40.53.01; 40.53.02 ; 40.53.22

Fax: 40 - 264 - 59.19.06

E-mail: [staff@staff.ubbcluj.ro](mailto:staff@staff.ubbcluj.ro)

RECTORATUL

## Universitatea Babeș-Bolyai Competiția Excelenței 2010

### Dosar individual

**Notă: Toate datele se referă la perioada 2005-2009**

Nume, prenume, grad did.	LAZAR DORINA, CONF. UNIV.
Facultatea, Catedra	FSEGA, STATISTICA, PREVIZIUNI, MATEMATICA
Domeniul științific	ȘTIINTE ECONOMICE
Adresa paginii web personale	-
Adresa e-mail	dorina.lazar@econ.ubbcluj.ro

### Criteria I – Output

**1. Articole științifice publicate în reviste indexate ISI (cu menționare factorului de impact în cazul celor cotate)**

**1.1. Lazar Dorina**, Denuit Michel, A multivariate time series approach to projected life tables, *Applied Stochastic Models in Business and Industry*, 25(6), 2009, p. 806 – 823, Factor de impact: 0.351.

**1.2. Lazar Dorina**, Filip Diana-Andrada, Naghy Andrea, Statistical tests for linear and nonlinear dependence and long-memory in Romanian stock market, *Carpathian Journal of Mathematics*, 25(1), 2009, p. 92 – 103.

**2. Articole științifice publicate în ISI proceedings**

**3. Articole științifice indexate în BDI (din lista CNCSIS)**

**3.1.** Filip Diana-Andrada, **Lazar Dorina**, The premium of inflation-indexed life insurances for the Romanian life table, *Transition Studies Review*, Springer, 2008, p.53-62, RePEc <http://ideas.repec.org/a/spr/trstrv/v15y2008i1p53-62.html>, EBSCO, EconLit, JEL on CD, SCOPUS.

**3.2. Lazar Dorina**, A note on pricing inflation-indexed life annuities, *Acta Oeconomica*, 2007, p. 363-376. SCOPUS, [http://info.scopus.com/documents/files/scopus-training/resourcelibrary/xls/title\\_list.xls](http://info.scopus.com/documents/files/scopus-training/resourcelibrary/xls/title_list.xls), EconLit, International Bibliographies IBZ/ IBR [http://www.degruyter.de/files/pdf/9783598690068Quellenliste\(d\).pdf](http://www.degruyter.de/files/pdf/9783598690068Quellenliste(d).pdf), JEL.

**3.3. Lazar Dorina**, Dumitru Ana Maria, Purchasing Power Parity in Transition Economies: Domestic Currency against the Euro, CEEOL, *Studia Universitatis Babeș-Bolyai Oeconomica*, 2007, p. 3-14. CEEOL <http://www.ceeol.com/aspx/issuedetails.aspx?issueid=efb6538a-7251-4ddc-b834-0eb5a52d27b0&articleId=ad5db8ec-29d0-41e7-8197-93679747cee8>

**3.4. Lazar Dorina**, Parpucea Ilie, Lazar Ioan, Theoretical and practical considerations regarding bonus-malus system, *Acta Universitas Apulensis Mathematics-Informatics*, 2007, p.57-66. Zentralblatt für Mathematik, <http://www.zentralblatt->

[math.org/stmaz/en/?q=se:%22Acta%20Universitatis%20Apulensis.%20Mathematics%20-%20Informatics%22](http://math.org/stmaz/en/?q=se:%22Acta%20Universitatis%20Apulensis.%20Mathematics%20-%20Informatics%22).

**3.5. Fat Codruta Maria, Lazar Dorina,** Considerente asupra reformei administrative a sistemelor de pensii, *Revista Transilvana de Stiinte Administrative*, 1 (19), 2007, p. 43 – 55. EBSCO  
<http://www.ebscohost.com/titleLists/a9-journals.htm>.

**3.6. Lazar Dorina,** Dumitru Ana Maria, Testing purchasing power parity in Romania, *Studia Universitatis Babes Bolyai. Oeconomica*, 51, 2006, p.37 – 46. IBSS  
[http://www.lse.ac.uk/collections/IBSS/word\\_docs/Journals%20A\\_Z.xls](http://www.lse.ac.uk/collections/IBSS/word_docs/Journals%20A_Z.xls).

#### **4. Alte articole științifice/capitole publicate în reviste/volume cu referenți (peer-reviewed)**

**4.1. Lazar Dorina,** Elaborarea tabelelor de mortalitate: etape metode statistice utilizate, *Revista Romana de Statistica*, 11, 2006, p.19 – 37. Categ CNC SIS B+.

**4.2. Lazar Dorina,** Ureche Simina, Testing Efficiency of the Stock Market in Emerging Economies, *Analele Universitatii din Oradea-Stiinte Economice*, XVI, 2007, p.826 – 831, Categ CNC SIS B+.

**4.3. Lazar Dorina,** Pulhac Delia, Managementul riscului portofoliilor utilizand metodologia value-at-risk, *Revista de Studii si Cercetari Economice "Virgil Madgearu"*, 2, 2008, p.184-194.

**4.4. Lazar Dorina,** Lung Rodica Ioana, Filip Diana-Andrada, Evaluarea actuariala a riscurilor specifice pensiilor private, *Revista de Studii si Cercetari Economice "Virgil Madgearu"*, 1, 2008, p.73-82.

**4.4. Ciumas Cristina, Matis Dumitru, Sucala Lucia, Lazar Dorina,** The Analysis Of Unisex Annuities Installments Used In Calculus Of Contributions For Private Pensions, The Proceedings Of The International Conference Competitiveness And European Integration, Alma Mater, Editor: Matis Dumitru, 2007, p. 213-228.

**4.5. Dumitru, Ana Maria, Lazar Dorina,** Purchasing Power Parity in Countries from Central and Eastern Europe, International Conference, Ovidius University of Constanta, Editura Universitaria, ISBN: 978-973-742-586-7, Vol. 2, 2006, p. 552-557.

**4.6. Lazar, Dorina, Dumitru, A.M. (2005),** Stock Prices and Exchange Rate: A Cointegration Approach, Proceedings of the International Conference The Impact of European Integration on the National Economy, Babes-Bolyai University, Editura Risoprint, ISBN: 973-751-103-4, 2005, p. 73-85.

**4.7. Lazar Dorina., Ruxanda G, Botezatu, A (2007),** Cointegration analysis and error correction mechanism of money demand, Proceedings of the International conference Competitiveness and European Integration, Babes-Bolyai University, Cluj-Napoca, Editura Alma Mater, ISBN: 978-606-504-006-9, 2007, p.74-81

**4.8. Lazar, Dorina., Ciumas, Cristina., Pop Fanuta. (2005),** On Using Econometrics in Pricing Automobile Insurance, Poloucek, S., Stavarek, D. (eds.) *Future of Banking After the Year 2000 in the World and in the Czech Republic*, Karvina: Silesian University, 2005, p. 1285-1298.

#### **5. Cărți științifice publicate în edituri internaționale**

##### **6. Cărți științifice publicate în edituri naționale acreditate**

**6.1. Lazar Dorina,** *Introducere în Statistică Actuarială*, Editura Economică, București, 2007, 327 p..

**6.2. Buiga Anuta, Dragos Cristian, Parpucea Ilie, Lazar Dorina,** *Statistica descriptiva*, Editura Mediamira, Cluj-Napoca, 2009, 352 p.

#### **7. Editor de volume publicate în edituri naționale și internaționale**

#### **8. Brevete internaționale**

#### **9. Brevete naționale**

#### **10. Impact tehnologic al brevetelor: resurse financiare extrabugetare atrase în relație cu economia**

## **11. Realizări artistice naționale și internaționale (Domeniul Arte)**

(Expoziții, spectacole, concerte, publicații, filme, înregistrări)

### **Criteriul II – Prestigiu profesional**

#### **1. Citări ale articolelor ISI listate la Criteriul I**

1.1. Articolul notat 1.1. in cadrul Criteriului 1, citat in:

Pauline Barrieu, Harry Bensusan, Nicole El Karoui, Caroline Hillairet, Stéphane Loisel Claudia Ravanelli and Yahia Salhi, *Understanding, Modeling and Managing Longevity Risk: Key Issues and Main Challenges*, Working Papers, EconPapers, RePEc, [http://econpapers.repec.org/paper/halwpaper/hal-00417800\\_5fv1.htm](http://econpapers.repec.org/paper/halwpaper/hal-00417800_5fv1.htm)

#### **2. Alte citări ale lucrărilor listate mai sus**

#### **3. Citări în perioada 2005-2009 ale articolelor anterioare anului 2005**

3.1. Articolul "On Forecasting Mortality Using Lee-Carter Method" citat in:

Gourieroux C., Monfort A, Quadratic Stochastic Intensity and Prospective Mortality Tables, *Insurance: Mathematics and Economics*, (43), 2008, p.174-184 (revista cotata ISI).

#### **4. Distincții, premii și alte recunoașteri naționale și internaționale**

*Premiu national*, Premiu pentru carte, acordat de Asociatia Facultatilor de Economie din Romania, AFER, 2008.

#### **5. Studenți naționali atrași (activități de coordonare științifică și didactică)**

- Îndrumare lucrari de licență (număr lucrări susținute): aprox. 40
- Îndrumare lucrări de disertație (număr lucrări susținute): aprox. 30
- Doctoranzi (lista nominală a doctoranzilor înmatriculați resp. lista nominală a tezelor susținute) -
- Post-doctoranzi (lista nominală) -

#### **6. Studenți internaționali atrași (activități de coordonare științifică și didactică)**

- Îndrumare lucrari de licență (număr lucrări susținute)
- Îndrumare lucrări de disertație (număr lucrări susținute)
- Doctoranzi (lista nominală a doctoranzilor înmatriculați resp. lista nominală a tezelor susținute)
- Post-doctoranzi (lista nominală)

#### **7. Membru in comitetul de redacție la reviste ISI**

Referent (reviewer) in colectiv editorial international: revista *Insurance: Mathematics and Economics*, revistă cotată ISI.

#### **8. Membru in comitetul de redacție la reviste BDI**

Revista *Studia Universitatis Babes-Bolyai Oeconomica*, membru in Advisory Board.

#### **9. Participări la programe/granturi de cercetare finanțate din sursă internațională (se menționează și valoarea)**

#### **10. Participări la programe/granturi finanțate din sursă națională (se menționează și valoarea)**

10.1. *Asigurarile agricole - instrument al managementului de risc si de politica agricola comuna - reforma sistemului din romania in vederea integrarii in uniunea europeana*, Coordonator Ciumas Cristina, 2007, Grant CNCSIS tip A, Valoare 34500 RON.

10.2. *Metode cantitative în asigurări de persoane și bunuri*, Coordonator Filip Diana-Andrada, 2007-2008, Grant Academia Română nr. 185/3.09.2007 și nr. 180/25.05.2008, Valoare 4000 RON.

**10.3. Reforma sistemului asigurarilor sociale din Romania in vederea aderarii la Uniunea Europeana**, Coordonator Nistor Ioan, 2005-2007, Grant CNCISIS tip A, 27600 RON.

**10.4. Metode de acoperire a riscului valutar si de dobanda**, Coordonator Fat Codruta Maria, 2007, UBB TP Teme Prioritare, Valoare 12495 RON.

**10.5. Modele matematice si statistice in tarifarea asigurarilor de viata si non viata**, Coordonator Filip Diana, 2009-2011, Grant Idei, Valoare 88494.53 RON pentru anul 2009.

**11. Coordonări de programe/granturi finanțate din sursă internațională (se menționează și valoarea)**

**12. Coordonări de programe/granturi finanțate din sursă națională (se menționează și valoarea)**

**13. Profesor invitat la universitati de prestigiu, cu titlu oficial**

**14. Membru în comisii profesionale relevante, cu titlu oficial**

Responsabil ID, Catedra Statistica, Previziuni, Matematica

**15. Conferințe invitate internaționale**

**16. Membru în comitete de organizare sau științifice ale unor conferințe internaționale**

### **III. Realizare remarcabilă**

Realizare stiintifica importanta din ultimii 5 ani și impactul acesteia.

Demersul stiintific din ultimii 5 ani a constat in principal in cercetarea si elaborarea unor lucrari ce se incadreaza in sfera statisticii actuariale si a evaluarii riscului financiar. Pe aceasta linie, contribuțiile științifice semnificative s-au concretizat in: a) elaborarea unei cărți în domeniul statisticii actuariale, carte ce abordează tematici puțin dezbătute în literatura noastră de specialitate, deosebit de utilă în contextul cererii crescute de specialiști în actuariat, în țara noastră, respectiv b) derularea unei colaborari internationale cu prof. Michel Denuit, Institut de Statistique, Universite Catholique de Louvain ([www.actu.ucl.ac.be/staff/denuit/mdenuit.html](http://www.actu.ucl.ac.be/staff/denuit/mdenuit.html)), profesor cu o activitate de cercetare valoroasa, avand ca finalitate publicarea unor articole in reviste cu vizibilitate si impact international.

Articolele au ca punct central utilizarea econometriei în abordarea unor teme din actuariat si finante; teme abordate in articolele publicate / in curs de publicare: modelarea multivariata a tabelor de mortalitate pe varste, tarifarea anuităților indexate cu inflația, analiza multivariata a ciclurilor de afaceri in asigurari, modelarea tranzitiilor specifice perioadei active, tarifarea asigurărilor de autovehicule, evaluarea riscurilor financiare.

Cercetarea derulata in colaborare cu prof. Michel Denuit a inceput prin dezvoltarea ideilor abordate in lucrarea „On Forecasting Mortality Using Lee-Carter Method” (lucrare prezentata la o conferinta internationala), si s-a concretizat in: a) publicarea unui articol intr-o revista cotata ISI, privind abordarea multivariata a tabelor prospective in asigurari, b) un articol aflat in curs de publicare (primit de la referenti pentru revizuire), asupra factorilor determinanti ai ciclicitatii in asigurari, c) doua articole in proces de finalizare; unul dintre articole, privind modelarea tranzitiilor specifice perioadei active, este in colaborare si cu Marcus Christiansen, cercetator la Universite Catholique de Louvain.

Pe langa aceste teme, articolele publicate vizeaza utilizarea modelării econometrice în elaborarea unei metodologii de tarifare a anuităților indexate cu inflația și în tarifarea asigurărilor de autovehicule, evaluarea riscului financiar utilizand marimea value-at-risk, analiza rentabilitatii pietei de capital, utilizarea econometriei in studiul empiric al validitatii unor teorii din macroeconomie si finante. Contributia stiintifica semnificativa adusa de articolele publicate priveste in principal metodologia statistica si econometrica.

Data: 15.03.2010

Semnătura:

**Certific validitatea datelor prezentate**

Sef de catedră,