

Bogdan Cristian NEGREA

Profesor universitar

Doctor în științe economice al Universității Paris 1 Panthéon-Sorbonne

născut pe 20 Decembrie 1971

Naționalitate: română

E-mail : bogdan.negrea@fin.ase.ro

bc.negrea@gmail.com



Adresa profesională:

Academia de Studii Economice din București

6, Piața Romană, Sector 1

010374 București, România

Tel: (+40)21319 20 24

I. STUDII

- 2005** Doctorat în științe economice la Universitatea Paris I Panthéon-Sorbonne, obținut cu distincția maximă « *très honorable avec les félicitations du jury* ». Titlul tezei : « *La volatilité stochastique et la valorisation des options* », conducător științific : Profesor Thierry Chauveau. Comisia de doctorat a fost formată din profesori de la universități din Franța și Elveția.
- 2000** Diplomă de studii aprofundate (master) « *Monnaie, Finance, Banque* » la Universitatea Paris I Panthéon-Sorbonne.
- 1997** Diplomă de studii aprofundate (master) « *Piețe financiare și valutare* », DOFIN, la Academia de Studii Economice, Facultatea de Finanțe, Asigurări, Bănci și Burse de Valori.
- 1996** Licență în « *Finanțe-Bănci* » la Academia de Studii Economice, Facultatea de Finanțe, Bănci și Contabilitate.

II. ACTIVITATE DE PREDARE IN INVATAMANTUL UNIVERSITAR

din 2007 *Profesor universitar* la Departamentul de Monedă și Bănci, Facultatea de Finanțe, Asigurări, Bănci și Burse de Valori din cadrul Academiei de Studii Economice din București.

Discipline predate:

- Inginerie financiară
- Evaluarea derivativilor financiare
- Microstructuri ale pieței financiare
- Evaluarea activelor financiare
- Modelarea deciziei financiar-monetare

III. CERCETARE

1. Articole publicate (selectiv)

- ◇ « *A Statistical Measure of Financial Crises Magnitude* », **Physica A: Statistical Mechanics and its Applications**, vol. 397, 2014.
- ◇ « *Credit Risk Dependence Modeling for Collateralized Debt Obligations* », **Economic Computation and Economic Cybernetics Studies and Research**, vol. 4, 2013 (cu G. Gaiduchevicei).
- ◇ « *How to Compute the Liquidity Cost in the Orders-Driven Market?* », **The Review of Finance and Banking**, 3 (1), 2011.
- ◇ « *A Note on Skenness in the Stochastic Volatility Models* », **Economic Computation and**

Economic Cybernetics Studies and Research, vol. 1, 2010.

- ◇ « *A Note on Skewness and Kurtosis Adjusted Option Pricing Models under the Martingale Restriction* », **Quantitative Finance**, vol.4, 2004 (cu E. Jurczenko și B. Maillet).
- ◇ « *La volatilité des marchés augmente-t-elle ?* », **Revue d'Economie Financière**, no. 74, May 2004 (cu T. Chauveau, B. Maillet, E. Jurczenko, J. Héricourt, H. Raymond-Feingold, C. Lubochinsky, S. Friederich și C. Moussu).
- ◇ « *Revisited Multi-moment Approximate Option Pricing Models (Part 1)* », **London School of Economics – Financial Markets Group (LSE-FMG)**, no. 430, 2002 (cu B. Maillet și E. Jurczenko).
- ◇ « *Skewness and Kurtosis Implied by Option Prices: A Second Comment* », **London School of Economics – Financial Markets Group (LSE-FMG)**, no. 419, 2002 (cu B. Maillet și E. Jurczenko).

2. Cărți (selectiv)

- ◇ « *Calcul stocastic aplicat în inginerie financiară* » (cu V. Damian), Editura Economică, București, 2016.
- ◇ « *Microstructura piețelor financiare* » (cu L. Tatu, D. Tatu, B. Murărașu și N. Ciurilă), Editura Universitară, București, 2009.
- ◇ « *Evaluarea activelor financiare: o introducere în teoria proceselor stocastice aplicate în finanțe* », Editura Economică, București, 2006.

3. Conferințe internaționale (selectiv)

- ◇ MFS Conference (Multinational Finance Society), Barcelona, Iunie 2010, *The Financial Crises Magnitude. An Approach based on the Earthquake Richter Scale*.
- ◇ EFMA Conference (European Financial Management Association), Milan, Iunie 2009, *How to Compute the Liquidity Cost in a Market Governed by Orders?*
- ◇ EFMA Conference (European Financial Management Association), Madrid, Iunie 2006, *A Note on Skewness in The Stochastic Volatility Models*.
- ◇ EFMA Conference (European Financial Management Association), Basel, Iunie 2004, *A Stochastic Volatility Model, Volatility Smile and Forecasting Volatility*.
- ◇ Ateliers de la MSE, Paris, Aprilie 2002, *Option Pricing with Stochastic Volatility*.
- ◇ EFMA Conference (European Financial Management Association), London, Iunie 2002, *Option Pricing with Stochastic Volatility: A Closed Form Solution using Fourier Transform*.
- ◇ FFM Conference (Forecasting Financial Markets), London, Mai 2001, *Multi-moment Approximate Option Pricing Models: A General Comparison of Hedging and Pricing Performances*.

4. Granturi/Contracte de cercetare câștigate prin competiție (selectiv)

- ◇ *Măsurarea amplitudinii crizelor și turbulențelor pe piața financiară prin utilizarea unor indici construiți pe baza scării Richter din seismologie. O aplicație a principiilor econofizicii.*, 2007-2009, proiect PN II-IDEI, finanțat de CNCISIS. Calitatea în cadrul echipei: director.
- ◇ *Un model stocastic de evaluare a anticipațiilor de pe piața financiară la termen: o soluție analitică utilizând transformata Fourier*, 2007-2008, proiect finanțat de CNCISIS. Calitatea în cadrul echipei: director.
- ◇ *Este investitorul român incitat să fie riscofil sau riscofob? Sau despre impactul asimetriei de informații asupra lichidității și volatilității pieței și coeziunea piețelor financiare europene*, 2006-2008, proiect CEEX, finanțat de UEFISCSU. Calitatea în cadrul echipei: director.

5. Prestigiu profesional

- ◇ Studiile realizate au fost citate în reviste cotate ISI sau în publicații de circulație internațională. Studiile sunt citate de către cercetători de la universități de prestigiu din USA, Franța, Marea

Britanie, Spania, Elveția, Norvegia, Cipru, Turcia, Japonia, Australia, Coreea de Sud, etc.

IV. ALTE ACTIVITĂȚI

- ◇ Prorector al ASE București, responsabil cu cercetarea științifică, dezvoltarea și inovarea (2016-2017).
- ◇ Director al Departamentului de Monedă și Bănci din cadrul Facultății de Finanțe, Asigurări, Bănci și Burse de Valori, ASE București. (2008-2016).
- ◇ Editor-șef al revistei științifice *The Review of Finance and Banking*.
- ◇ Profesor invitat la Universitatea Rennes 1, Franța (2012 și 2014).
- ◇ Președinte al Comisiei de Științe Economice și Administrarea Afacerilor din cadrul CNATDCU (2011-2012 și 2016-2017).
- ◇ Director al Centrului de cercetări pentru promovarea publicării în reviste ISI: CERV-ISI, laborator al ASE, București, în perioada 2006-2008.
- ◇ Cercetător asociat la Centre d'Economie de la Sorbonne – Théorie Et Applications en Microéconomie et Macroéconomie (CES-TEAM), laborator al universităților: Université Paris 1 (Panthéon-Sorbonne) și Ecole Normale Supérieure (ENS), în perioada 2005-2009.
- ◇ ATER (Attaché Temporaire d'Enseignement et de Recherche – Angajat temporar pentru activități de predare și cercetare) la Universitatea Paris 1 (Panthéon-Sorbonne), în perioada 2003-2005.

V. DIVERSE

- ◇ **Informatică:** MS Office, Scientific Workplace, Gauss, Matlab, Eviews.
- ◇ **Limbi străine:** Franceză (bilingv), Engleză (avansat).
- ◇ **Hobby:** muzică clasică, arte plastice, călătorii, sport.