

Bogdan Cristian NEGREA

născut pe 20.12.1971, celibatar
naționalitate : română
e-mail : negrea@univ-paris1.fr



Adresa profesională :

Profesor universitar doctor
Catedra de Monedă , ASE, FABBV
Piața Romana, Nr. 6, Sector 1
701631 Bucuresti
Tel/fax : (+4021)212 52 41

Cercetător asociat doctor
Centre d'Economie de la Sorbonne
MSE/CES-TEAM CNRS
106-112, Bd. de l'Hôpital
75647 Paris Cedex 13
Tél / Fax : (+331) 44 07 82 69/70

I. STUDII

- 2005** Doctorat în științe economice la Universitatea Paris I Panthéon-Sorbonne cu mențiunea maximă « *très honorable avec les félicitations du jury* ». Titlul tezei : « *La volatilité stochastique et la valorisation des options* », conducător științific : Profesor Thierry Chauveau.
- 2000** Diplomă de studii aprofundate « *Monnaie, Finance, Banque* » la Universitatea Paris I Panthéon-Sorbonne.
- 1997** Diplomă de studii aprofundate « *Piețe financiare și valutare* » la Academia de Studii Economice, Facultatea de Finanțe, 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

- 2007-prezent** *Profesor universitar* la Catedra de Monedă, ASE.
- 2006-2007** *Conferențiar universitar* la Catedra de Monedă, ASE
- 2005-2006** *Lector universitar* la Catedra de Monedă, ASE.
- 2003-2005** *ATER* (Attaché Temporaire à l'Enseignement et à la Recherche) la Universitatea Paris I Panthéon-Sorbonne.
- 2003-2004** *Lector universitar* la Catedra de Monedă, ASE.
- 2000-2003** *Allocataire de recherche* la Universitatea Paris I Panthéon-Sorbonne.
- 1996-2000** *Preparator și asistent universitar* la Catedra de Monedă, ASE.
- Materii predate**
- Inginerie financiară
 - Modelarea deciziilor financiar monetare
 - Econometrie
 - Econometrie financiară
 - Piețe de capital
 - Gestiune bancară
 - Evaluarea activelor financiare
 - Managementul riscului
 - Instruments et marchés financiers
 - Finance Internationale
 - Mathématiques financières

III. CERCETARE

1. Articole publicate în reviste internaționale

- ◇ « *A note on skewness and kurtosis adjusted option pricing models under the Martingale restriction* », **Quantitative Finance**, vol.4, october **2004** (în colaborare cu E. Jurczenko – ESCP-EAP și B. Maillet – Université Paris 1).
- ◇ « *La volatilité des marchés augmente-t-elle ?* », **Revue d'Economie Financière**, n° 74, mai **2004** (în colaborare cu T. Chauveau – Université Paris 1, B. Maillet – Université Paris 1, E. Jurczenko – ESCP-EAP, J. Héricourt – Université Paris 1, H. Raymond-Feingold – Université Paris 1, C. Lubochinsky – Université Paris 2, S. Friederich – London School of Economics, C. Moussu – ESCP-EAP).
- ◇ « *Revisited Multi-moment Approximate Option Pricing Models (Part 1)* », **London School of Economics – Financial Markets Group** (LSE-FMG), nr. 430, **2002** (în colaborare cu B. Maillet și E. Jurczenko - Université Paris 1).
- ◇ « *Skewness and Kurtosis Implied by Option Prices: A Second Comment* », **London School of Economics – Financial Markets Group** (LSE-FMG), nr. 419, **2002** (în colaborare cu B. Maillet și E. Jurczenko - Université Paris I).
- ◇ « *Evaluation des options par la transformée de Fourier* », **Cahiers de la MSE**, nr. 31, **2001**.

2. Articole publicate în reviste naționale

- ◇ « *Social welfare and development index* », **Analele Universității din Oradea**, tom XVI, vol. I, **2007**, (în colaborare cu L. Țățu, D. Țățu., R. Bărbulescu – ASE).
- ◇ « *Bid-ask spread estimation for bvb stocks* », **Analele Universității din Oradea**, tom XVI, vol. II, **2007**, (în colaborare cu L. Țățu, D. Țățu., R. Bărbulescu – ASE).
- ◇ « *Influența deductibilității cheltuielilor cu dobânzile asupra costului capitalului împrumutat al unei societăți comerciale* », **Revista Finanțe, Bănci, Asigurări**, nr 1, **2004** (în colaborare cu L.Țățu și V. Dragotă – ASE București).
- ◇ « *Analiza și gestiunea portofoliului după modelul diagonal al lui Sharpe* », **Economistul**, nr.938/ **1997** (în colaborare cu I. Stancu și S. Lazarescu – ASE București).

3. Cărți de specialitate

- ◇ « *Evaluarea activelor financiare: O introducere în teoria finanțelor stocastice* », Editura Economica, București, 2006.
- ◇ « *Inginerie Financiară* », Editura ASE, București, 2006.
- ◇ « *La volatilité des marchés financiers* », Capitolul 1: *Mesurer l'instabilité financière*, Editions AEF, Paris, 2004 (în colaborare cu T. Chauveau – Université Paris 1, B. Maillet – Université Paris 1, E. Jurczenko – ESCP-EAP, J. Héricourt – Université Paris 1, H. Raymond-Feingold – Université Paris 1, C. Lubochinsky – Université Paris 2, S. Friederich – London School of Economics, C. Moussu – ESCP-EAP).

4. Conferințe internaționale

- ◇ European Working Group on Financial Modelling Conference, Nice, noiembrie **2006**, *Capital markets development and economic growth: the case of Romania*.
- ◇ 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*.

- ◇ FFM Conference (Forecasting Financial Markets), Paris, iunie **2003**, *Recovering Constrained Implied Risk-neutral Moments for Option Pricing with a Parallel Stochastic Hybrid Self-adapted Genetic Algorithm.*
- ◇ AFFI Conference (Association française de finance), Paris, decembrie **2002**, *Recovering Constrained Implied Risk-neutral Moments for Option Pricing with a Parallel Stochastic Hybrid Self-adapted Genetic Algorithm.*
- ◇ FFM Conference (Forecasting Financial Markets), Londra, mai **2002**, *Recovering Constrained Implied Risk-neutral Moments for Option Pricing with a Parallel Stochastic Hybrid Self-adapted Genetic Algorithm.*
- ◇ EEA-ESEM Conference (European Economic Association – Econometric Society), Venetia, august **2002**, *Simplified Multi-moment Approximate Option Pricing Models.*
- ◇ AFFI Conference (Association française de finance), Strasbourg, iunie **2002**, *Multi-moment Approximate Option Pricing (Part 1).*
- ◇ Ateliers de la MSE, Paris, aprilie **2002**, *Option Pricing with Stochastic Volatility.*
- ◇ EFMA Conference (European Financial Management Association), Londra, iunie **2002**, *Option Pricing with Stochastic Volatility: A Closed Form Solution using Fourier Transform.*
- ◇ JMA Conference (Journées de Macroéconomie Appliquée), Rennes si St. Malo, iunie **2002**, *Multi-moment Approximate Option Pricing Models: A General Comparison.*
- ◇ FFM Conference (Forecasting Financial Markets), Londra, mai **2001**, *Multi-moment Approximate Option Pricing Models: A General Comparison of Hedging and Pricing Performances.*

5. Conferințe naționale

- ◇ International Conference „Economy, Society, Civilization”, Bucharest, iulie **2007**, *A Stochastic Volatility Model of Investors Anticipations Valuation: An Analytic Solution Using The Fourier Transform.*
- ◇ International Conference „Economy, Society, Civilization”, Bucharest, iulie **2007**, *The Impact of Trade Volume on Stock Prices. An Econometric Investigation.*
- ◇ Sesiunea Stiintifica a FABBV, Coordonate europene ale sistemului financiar din România, ASE, Bucuresti, noiembrie **2006**, *Comportamentul investitorilor pe piața de capital din România și creșterea economică.*
- ◇ Sesiunea Stiintifica a FABBV, Finantele si dezvoltarea durabila, ASE, Bucuresti, noiembrie **2003**, *Un model de evaluare a optiunilor cu volatilitate stocastica.*
- ◇ Sesiunea Stiintifica a FABBV, Finantele si dezvoltarea durabila, ASE, Bucuresti, noiembrie **2003**, *Influența impozitului pe profit asupra costului capitalului împrumutat al unei societăți comerciale.*
- ◇ Sesiunea Stiintifica a Academiei Romane, Centrul V. Slavescu, Bucuresti, octombrie **2003**, *Evaluarea activelor financiare derivate: o solutie analitica utilizand transformata Fourier.*
- ◇ Sesiunea Stiintifica FABBV, ASE **1997**, *Modelul diagonal al lui Sharpe.*
- ◇ Simpozion international BNR: Sisteme monetare –trecut, prezent si viitor, **1997**, *Cooperarea europeana si activitatea bancilor in Romania.*

6. Contracte/granturi de cercetare

- ◇ *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, cu durata de 3 ani, proiect PN II – IDEI, având ca beneficiar CNCSIS. 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, cu durata de 1 an, proiect CNCSIS tip A, având ca beneficiar CNCSIS. 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, cu durata de 2 ani, proiect CEEX, având ca beneficiar UEFISCSU. Calitatea în cadrul echipei: **director**.
- ◇ *La volatilité stochastique des actifs financiers*, 2000, cu durata de 3 ani, contract de cercetare CNRS (Centre National de la Recherche Scientifique) finanțat de guvernul Franței, având ca beneficiar Ministère de la Recherche. Calitatea în cadrul echipei: **director**.
- ◇ *Studiul comportamentului investitorilor pe piața de capital și impactul acestuia asupra creșterii economice*, 2006, cu durata de 2 ani, proiect CEEX, având ca beneficiar UEFISCSU. Calitatea în cadrul echipei: **membru**.
- ◇ *Riscul operațional: cuantificare și gestionare în contextul implementării acordului de la Basel II la Bancpost*, 2005, cu durata de 9 luni, contract instituțional finanțat de Bancpost, având ca beneficiar Bancpost. Calitatea în cadrul echipei: **membru**.
- ◇ *Tehnologii informatice privind colectarea on-line a declarațiilor fiscale, centralizarea și prelucrarea automată a datelor la nivel național*, 2006, cu durata de 1 an, proiect CNCISIS tip A, având ca beneficiar CNCISIS. Calitatea în cadrul echipei: **membru**.
- ◇ *Analiza și modelarea influențelor structurale asupra indicatorilor de performanță ai economiei naționale*, 1998, cu durata de trei ani, cod CNCISIS 7, finanțat de Banca Mondială (70%) și Guvernul României (30%), având ca beneficiar CNCISIS. Calitatea în cadrul echipei: **membru**.

IV. ALTE ACTIVITATI

- ◇ 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).
- ◇ Director al Centrului de cercetări pentru promovarea publicării în reviste ISI: CERV-ISI, laborator al ASE, București.
- ◇ Chairman la secțiunea « Options » la conferința EFMA « European Financial Management Association », Madrid, iunie 2006.
- ◇ Membru al asociației « Finance sur Seine », al asociației « Association française de finance » și al asociației « European Financial Management Association ».

V. DIVERSE

- ◇ **Informatică** : MS Office, Scientific Workplace, Gauss, Matlab, Mathematica, SAS, Eviews.
- ◇ **Limbi străine** : franceză (bilingv), engleză (curent).
- ◇ **Hobby** : muzică clasică, arte plastice, călătorii, sport.