

LISTA DE LUCRĂRI

Candidat: MATEI, V. Marius - **Dr.**/ din 27.07.2010 (în Economie) și din 20.4.2012 în Științele Managementului (specializare Econometrie Financiară)

1 Lista celor maximum 10 lucrări considerate de candidat a fi cele mai relevante pentru realizările profesionale proprii, care sunt incluse în format electronic în dosar și care se pot regăsi și în celelalte categorii de lucrări din prezenta listă de lucrări:

1. Dungey Mardi, Erdemlioglu Deniz, **Matei Marius** și Yang Xiye, *Testing for mutually exciting jumps and financial flights in high frequency data*, Journal of Econometrics, 2018, Volume 202, Issue 1, Pages 18-44, Impact factor 2,388, ISSN: 0304-4076, WOS: 000418106300002, DOI: 10.1016/j.jeconom.2017.09.002; publicație indexată în Baza ISI
2. Dungey Mardi, **Matei Marius** și Treepongkaruna Sirimon, *Examining stress in Asian currencies: A perspective offered by high frequency financial market data*, Journal of International Financial Markets, Institutions & Money, Vol 67 (101200), 1-18, Impact factor 4,211, ISSN: 1042-4431, DOI: 10.1016/j.intfin.2020.101200; publicație indexată în Baza ISI
3. Dungey Mardi, Luciani Matteo, **Matei Marius** și Veredas David, *Surfing through the GFC: Systemic risk in Australia*, Economic Record, 2017, Volume 93, Issue 300, Pages 1-19, Impact factor 1,246, ISSN: 0013-0249, WOS: 000399319600001, DOI: 10.1111/1475-4932.12309; publicație indexată în Baza ISI
4. **Matei Marius**, Rovira Xari și Agell Xari, *Bivariate volatility modelling with high frequency data*, Econometrics, 2019, Volume 7, Issue 3, Article number 41, ISSN 2225-1146, DOI: 10.3390/econometrics7030041 ; publicație indexată în Baza ISI
5. Huang Wen, Huang Zhuo, **Matei Marius** și Wang Tianyi, *Price volatility forecast for agricultural commodity futures: the role of high frequency data*, Romanian Journal of Economic Forecasting, 2012, Volume 15, Issue 4, Pages 83-103, Impact factor 0,831, ISSN: 1582-6163, WOS: 000313533000006; publicație indexată în Baza ISI
6. **Matei Marius**, *Perspectives on risk measurement - a critical assessment of PC-GARCH against the main volatility forecasting models*, Romanian Journal of Economic Forecasting, 2012, Volume 15, Issue 1, Pages 95-115, Impact factor 0,831, ISSN: 1582-6163, WOS:000302395700006; publicație indexată în Baza ISI
7. **Matei Marius**, *Non-linear volatility modelling of economic and financial time series using high frequency data*, Romanian Journal of Economic Forecasting, 2011, Volume 14, Issue 2, Pages 116-141, Impact factor 0,831, ISSN: 1582-6163, WOS: 000292851100009; publicație indexată în Baza ISI
8. **Matei Marius**, *Assessing volatility forecasting models: why GARCH models take the lead*, Romanian Journal of Economic Forecasting, 2009, Volume 12, Issue 4, Pages 42-65, Impact factor 0,831, ISSN: 1582-6163, WOS: 000273227400003; publicație indexată în Baza ISI

2 Tezele de doctorat

T1 Teza 1: “*Analiza riscului în evaluarea oportunităților internaționale de investiții. Perspective în modelarea și previzionarea volatilității utilizate în estimarea riscului*” | “*Risk analysis in the evaluation of the international investment opportunities. Advances in modeling and forecasting volatility for risk assessment purposes*”, Institutul Național de Cercetări Economice “Costin C. Kirițescu” | Academia Română, România, 2010

T2 Teza 2: “*A contribution to multivariate volatility modelling with high frequency data*”, ESADE Business School, University Ramon Llull, Spain, 2012

3 Cărți/cursuri publicate în edituri recunoscute(Ca1, Ca2 etc.), îndrumare publicate(I1, I2 etc.), capitole publicate în volume colective, capitole teoretice redactate, (D1, D2 etc.), după caz, prin care se aduc contribuții a dezvoltarea activităților didactice/profesionale.

Ca1: Autor carte - **Matei Marius**, “*Risk and volatility. Theory, methods and econometric modelling*”, suport de curs, Editura Economică, 2021, ISBN 978-973-709-989-1

Ca2: Autor carte - **Matei Marius**, “*Tehnici de previzionare a volatilității și randamentelor seriilor de timp cu date cu frecvență mare. Binomul macro-micro din perspectiva tehnicilor de agregare și sintetizare a datelor*”, suport de curs, Editura Expert, 2013, ISBN 978-973-618-380-5

D1: Autor capitol - **Matei Marius**, “*Non-linear volatility modelling of economic and financial time series using high frequency data*”, publicat în “*Non-Linear Modelling in Economics - Beyond Standard Economics*”, Expert: București, 2011, ISBN 978-973-618-260-0, 310 pagini (capitol pag. 66-94)

<https://www.amazon.com/NON-LINEAR-MODELLING-ECONOMICS-STANDARD-Economy-ebook/dp/B00EVHHTNY>

D2: Autor capitol - **Matei Marius**, “*Modelling and measuring jumps in high frequency data*”, publicat în “*Selected issues in macroeconomic and regional modelling: Romania an emerging country in EU*”, Nova Science Publishers: NY, 2015, ISBN 978-1-63484-936-4, 320 pagini (capitol pag. 245-254)

https://www.novapublishers.com/catalog/product_info.php?products_id=58006

D3: Autor capitol - **Matei Marius**, Rovira Xari, Agell Nuria, “*Bivariate volatility modelling with high-frequency data*”, publicat în “*Recent advances in theory and methods for the analysis of high dimensional and high frequency financial data*”, MDPI: Basel, ISBN 978-3-0365-0852-8, 183 pagini (capitol pag. 53-67)

<https://www.mdpi.com/books/pdfview/book/3961>

4 Cărți de specialitate publicate în edituri recunoscute(Cb1, Cb2 etc.), **articole/studii** publicate in extenso în reviste de specialitate de circulație internațională recunoscute (reviste cotate ISI sau indexate în baze de date internaționale specifice domeniului)(Ri1, Ri2etc.), **articole/studii in extenso** publicate în volumele unor manifestări științifice internaționale recunoscute din țară și din străinătate (cu ISSN/ ISBN)(Vi1, Vi2 etc.), precum și **alte lucrări similare**: articole/studii publicate in extenso în reviste de specialitate de circulație națională recunoscute CNCSIS (Rn1, Rn2 etc.), articole/studii

publicate in extenso în volumele unor manifestări științifice naționale (cu ISSN/ISBN)(Vn1,Vn2 etc.), lucrări prezentate la diferite seminarii/expoziții, inovații etc.(E1, E2 etc.), după caz, prin care se aduc contribuții la dezvoltarea domeniului.

Cb1: Autor carte - Matei Marius, “*Risk and volatility. Theory, methods and econometric modelling*”, suport de curs, Editura Economică, 2021, ISBN 978-973-709-989-1

Cb2: Autor carte - Matei Marius, “*Tehnici de previzionare a volatilității și randamentelor seriilor de timp cu date cu frecvență mare. Binomul macro-micro din perspectiva tehnicilor de agregare și sintetizare a datelor*”, suport de curs, Editura Expert, 2013, ISBN 978-973-618-380-5

Ri1: Dungey Mardi, Erdemlioglu Deniz, Matei Marius și Yang Xiye, *Testing for mutually exciting jumps and financial flights in high frequency data*, Journal of Econometrics, 2018, Volume 202, Issue 1, Pages 18-44, Impact factor 2,388, ISSN: 0304-4076, WOS: 000418106300002, DOI: 10.1016/j.jeconom.2017.09.002; publicatie indexata ISI

Ri2: Dungey Mardi, Matei Marius și Treepongkaruna Sirimon, *Examining stress in Asian currencies: A perspective offered by high frequency financial market data*, Journal of International Financial Markets, Institutions & Money, Vol 67 (101200), 1-18, Impact factor 4,211, ISSN: 1042-4431, DOI: 10.1016/j.intfin.2020.101200; publicație indexată în Baza ISI

Ri3: Dungey Mardi, Luciani Matteo, **Matei Marius** și Veredas David, *Surfing through the GFC: Systemic risk in Australia*, Economic Record, 2017, Volume 93, Issue 300, Pages 1-19, Impact factor 1,246, ISSN: 0013-0249, WOS:000399319600001, DOI: 10.1111/1475-4932.12309; publicatie indexata in Baza ISI

Ri4: Matei Marius, Rovira Xari și Agell Xari, *Bivariate volatility modelling with high frequency data*, Econometrics, 2019, Volume 7, Issue 3, Article number 41, ISSN 2225-1146, DOI: 10.3390/econometrics7030041 ; publicatie indexata in Baza ISI

Rn1: Huang Wen, Huang Zhuo, **Matei Marius** și Wang Tianyi, *Price volatility forecast for agricultural commodity futures: the role of high frequency data*, Romanian Journal of Economic Forecasting, 2012, Volume 15, Issue 4, Pages 83-103, Impact factor 0,831, ISSN: 1582-6163, WOS:000313533000006; publicatie indexata in Baza ISI

Rn2: **Matei Marius**, *Perspectives on risk measurement - a critical assessment of PC-GARCH against the main volatility forecasting models*, Romanian Journal of Economic Forecasting, 2012, Volume 15, Issue 1, Pages 95-115, Impact factor 0,831, ISSN: 1582-6163, WOS:000302395700006; publicatie indexata in Baza ISI

Rn3: **Matei Marius**, *Non-linear volatility modelling of economic and financial time series using high frequency data*, Romanian Journal of Economic Forecasting, 2011, Volume 14, Issue 2, Pages 116-141, Impact factor 0,831, ISSN: 1582-6163, WOS:000292851100009; publicatie indexata in Baza ISI

Rn4: **Matei Marius**, *Assessing volatility forecasting models: why GARCH models take the lead*, Romanian Journal of Economic Forecasting, 2009, Volume 12, Issue 4, Pages 42-65, Impact factor 0,831, ISSN: 1582-6163, WOS:000273227400003; publicatie indexata in Baza ISI

5. Citări ale lucrărilor publicate: referința bibliografică a lucrării citate (Ci1, Ci2) și referința / ele bibliografică / e a / ale lucrării care citează (Ci1.1, Ci1.2....., Ci2.1, Ci2.2, etc.)

Listă citări (din care autocitările și semiautocitările au fost excluse - am considerat autocitare existența unui autor/coautor comun între lucrarea citată și lucrarea care citează):

- Ci1 Dungey Mardi, Erdemlioglu Deniz, **Matei Marius** și Yang Xiye, *Testing for mutually exciting jumps and financial flights in high frequency data*, Journal of Econometrics, 2018, Volume 202, Issue 1, Pages 18-44, Impact factor 2,388, ISSN: 0304-4076, WOS: 000418106300002, DOI: 10.1016/j.jeconom.2017.09.002
- Ci1.1 Deng Shounian, Fei Chen, Fei Weiyin și Mao Xuerong, *Generalized Ait-Sahalia-type interest rate model with Poisson jumps and convergence of the numerical approximation*, Physica A-Statistical Mechanics and Its Applications, 2019, Volume: 533, Article Number: 122057, Impact factor 2,5, ISSN: 0378-4371, DOI: 10.1016/j.physa.2019.122057, AIS: 2
- Ci1.2 Corradi Valentina, Silvapulle Mervyn J. Swanson și Norman R., *Testing for jumps and jump intensity path dependence*, Journal of Econometrics, 2018, Volume: 204, Issue: 2 Pages: 248-267, Impact factor 2,388, ISSN: 0304-4076, WOS: 000433400200007, DOI: <https://doi.org/10.1016/j.jeconom.2018.02.004>, AIS: 1
- Ci1.3 Liu Guangying, Liu Meiyao și Lin Jinguan, *Testing the volatility jumps based on the high frequency data*, Journal of Time Series Analysis, 2021, Early Access, Impact Factor: 1,366, ISSN: 0143-9782, DOI: 10.1111/jtsa.12634, AIS: 2
- Ci1.4 Ozbekler Ali Gencay, Kontonikas Alexandros și Triantafyllou Athanasios, *Volatility forecasting in European government bond markets*, International Journal of Forecasting, 2021, Volume 37, Issue 4, October–December 2021, Pages 1691-1709, Impact Factor: 3,779, ISSN: 0169-2070, DOI: 10.1016/j.ijforecast.2021.03.009, AIS: 2
- Ci1.5 Yu Chao, Bi Jianxin și Zhao Xujie, *Modeling Financial Intraday Jump Tail Contagion with High Frequency Data Using Mutually Exciting Hawkes Process*, Discrete Dynamics In Nature And Society, 2020, Impact Factor: 1,348, ISSN: 1026-0226, DOI: 10.1155/2020/7940647, AIS: 4
- Ci1.6 Erdemlioglu Deniz și Gradojevic Nikola, *Heterogeneous investment horizons, risk regimes, and realized jumps*, International Journal of Finance & Economics, Volume 26, Issue 1, Pages 617-643, Impact Factor: 3,07, DOI: 10.1002/ijfe.1807, ISSN: 1076-9307, AIS: 3
- Ci1.7 Boswijk H. Peter, Laeven Roger J. A. și Yang Xiye, *Testing for self-excitation in jumps*, Journal of Econometrics, 2018, Volume 203, Issue 2, Page 256-266, Impact Factor: 2.388, DOI: 10.1016/j.jeconom.2017.11.007, ISSN: 0304-4076, AIS: 1
- Ci2 Dungey Mardi, **Matei Marius** și Treepongkaruna Sirimon, *Examining Stress in Asian Currencies: A Perspective Offered by High Frequency Financial Market Data*, Journal of International Financial Markets, Institutions & Money, Vol 67 (101200), 1-18, Impact factor 4,211, ISSN: 1042-4431, DOI: 10.1016/j.intfin.2020.101200; publicatie indexata ISI
- Ci2.1 Yalaman Abdullah și Manahov Viktor, *Analysing emerging market returns with high-frequency data during the global financial crisis of 2007-2009*, European Journal of Finance, 2021, Early Access, Impact factor: 1,809, DOI: 10.1080/1351847X.2021.1957698, ISSN: 1351-847X, AIS: 4

Ci2.2 Batten Jonathan, Loncarski Igor și Szilagyi Peter G., *Strategic insider trading in foreign exchange markets*, 2021, Journal Of Corporate Finance, Volume 69, Impact factor: 4,249, DOI:10.1016/j.jcorpfin.2020.101818, ISSN: 0929-1199, AIS: 1

Ci3 Dungey Mardi, Luciani Matteo, **Matei Marius** și Veredas David, *Surfing through the GFC: Systemic risk in Australia*, Economic Record, 2017, Volume 93, Issue 300, Pages 1-19, Impact factor 1,246, ISSN: 0013-0249, WOS:000399319600001, DOI: 10.1111/1475-4932.12309

Ci3.1 Cardak Buly A. și Martin Vance L., *Once in a Lifetime? The Effects of the Global Financial Crisis on Household Willingness to Take Financial Risk*, Economic Record, 2019, Impact factor 1,246, Volume 95, Issue 311, Pages 442-461, ISSN: 0013-0249, DOI: 10.1111/1475-4932.12506, AIS: 3

Ci3.2 Miranda-Pinto Jorge și Shen Yuanting, *A Granular View of the Australian Business Cycle*, Economic Record, 2019, Impact factor 1,246, Volume 95, Issue 311, Pages 407-424, ISSN: 0013-0249, DOI: <https://doi.org/10.1111/1475-4932.12495>, AIS: 3

Ci3.3 Van Cauwenberge Annelies, Vancauteran Mark, Braekers Roel și Vandemaele Sigrid, *International trade, foreign direct investments, and firms' systemic risk: Evidence from the Netherlands*, Economic Modelling, 2019, Impact factor 3,127, Volume 81, Pages: 361-386, ISSN: 0264-9993, DOI: 10.1016/j.econmod.2019.07.001, AIS: 3

Ci3.4 Bui Christina, Scheule Harald și Wu Eliza, *The value of bank capital buffers in maintaining financial system resilience*, Journal of Financial Stability, Volume 33, December 2017, Pages 23-40, Impact factor 2.301, ISSN: 1572-3089, WOS:000417189200002, DOI: <https://doi.org/10.1016/j.jfs.2017.10.006> (citarea se poate verifica atât prin Google Scholar, cât și prin consultarea listaei bibliografice de la sfârșitul acestei lucrări) , AIS: 2

Ci3.5 Daniel Rösch și Harald Scheule, *The role of loan portfolio losses and bank capital for Asian financial system resilience*, Pacific-Basin Finance Journal, 2016, Volume 40, Part B, Pages 289-305, Impact factor 1.442, ISSN: 0927-538X, WOS: 000390640100004, DOI: 10.1016/j.pacfin.2016.01.002 (citarea se poate verifica atât prin Google Scholar, cât și prin consultarea listaei bibliografice de la sfârșitul acestei lucrări) , AIS: 3

Ci3.6 Mikhail Anufriev și Valentyn Panchenko, *Connecting the dots: Econometric methods for uncovering networks with an application to the Australian financial institutions*, Journal of Banking & Finance, 2015, Volume 61, Pages S241–S255, Impact factor 2.205, ISSN: 0378-4266, WOS: 000368205300012, DOI: 10.1016/j.jbankfin.2015.08.034 (citarea se poate verifica atât prin Google Scholar, cât și prin consultarea listaei bibliografice de la sfârșitul acestei lucrări), AIS: 1

Ci3.7 Islam Raisul și Volkov Vladimir, *Contagion or interdependence?, Comparing spillover indices*, Empirical Economics, 2021, Early Access, Impact factor 1,713, DOI: 10.1007/s00181-021-02169-2, ISSN: 0377-7332, AIS: 3

Ci3.8 Fijorek Kamil, Jurkowska Aleksandra și Jonek-Kowalska Izabela, *Financial contagion between the financial and the mining industries - Empirical evidence based on the symmetric and asymmetric CoVaR approach*, Resources Policy, 2021, Impact factor 5,634, Volume 70, No. 101965, DOI: 10.1016/j.resourpol.2020.101965, ISSN: 0301-4207, AIS: 2

Ci3.9 Wang Xiaoting, Hou Siyuan și Shen Jie, *Default clustering of the nonfinancial sector and systemic risk: Evidence from China*, Economic Modelling, 2021, Impact factor 3,127, Volume 96, Page 196-208, DOI: 10.1016/j.econmod.2021.01.001, ISSN: 0264-9993, AIS: 3

Ci3.10 Jia Jing și Bradbury Michael E., *Risk management committees and firm performance*, Australian Journal of Management, 2021, Impact factor 2,422, DOI: 10.1177/0312896220959124, ISSN: 0312-8962, AIS: 4

Ci3.11 Yan Xin, Chen Min și Chen Mu-Yen, *Coupling and Coordination Development of Australian Energy, Economy, and Ecological Environment Systems from 2007 to 2016*, Sustainability, 2019, Impact Factor 3,251, Volume 11, Issue 23, Article Number: 6568, DOI: 10.3390/su11236568, eISSN: 2071-1050, AIS: 3

Ci3.12 Dungey Mardi, Luciani Matteo și Veredas David, *Systemic risk in the US: Interconnectedness as a circuit breaker*, 2018, Economic Modelling, Impact Factor 3,127, Volume 71, Page 305-315, DOI: 10.1016/j.econmod.2017.10.004, ISSN: 0264-9993, AIS: 3

Ci4 **Matei Marius**, Rovira Xari și Agell Xari, *Bivariate volatility modelling with high frequency data*, Econometrics, 2019, Volume 7, Issue 3, Article number 41, ISSN 2225-1146, DOI: 10.3390/econometrics7030041 ; publicație indexată în Baza ISI

Ci4.1 Bhowmik Roni și Wang Shouyang, *Stock Market Volatility and Return Analysis: A Systematic Literature Review*, 2020, Entropy, Impact Factor: 2,524, Volume 22, Issue 5, Article Number 522, eISSN: 1099-4300, DOI10.3390/e22050522, AIS: 2

Ci5 Banulescu Denisa, Hansen Peter Reinhard, Huang Zhuo și **Matei Marius**, 2015. *Volatility during the financial crisis through the lens of high frequency data: a realized GARCH approach*. Working Paper

Ci5.1 Grigoryeva Lyudmila, Ortega Juan-Pablo și Peresetsky Anatoly, *Volatility forecasting using global stochastic financial trends extracted from non-synchronous data*, Econometrics and Statistics, Volume 5, January 2018, Pages 67-82, DOI: <https://doi.org/10.1016/j.ecosta.2017.01.003>, ISSN: 2468-0389, WOS:000425742700004 ((citarea se poate verifica atât prin Google Scholar, cât și prin consultarea listei bibliografice de la sfârșitul acestei lucrări); de notat că din eroarea autorilor (Grigoryeva Lyudmila, Ortega Juan-Pablo, Peresetsky Anatoly) nu apare și numele meu la bibliografie, însă este vorba de același articol în care sunt listat și eu ca autor, titlul lucrării “*Volatility during the financial crisis through the lens of high frequency data: a realized GARCH approach*” fiind același), AIS: nu este în lista UEFISCDI

Ci5.2 Huang Zhuo, Liu Hao, Wang Tianyi, *Modeling long memory volatility using realized measures of volatility: A realized HAR GARCH model*, 2016, Economic Modelling, Impact Factor: 3,127, Volume 52, Page 812-82, Part B, DOI10.1016/j.econmod.2015.10.018, ISSN: 0264-9993, AIS: 3

Ci5.3 Xie Haibin, Yu Chengtan, *Realized GARCH models: Simpler is better*, 2020, Finance Research Letters, Impact Factor: 5,596, Volume 33, Article Number 101221, DOI10.1016/j.frl.2019.06.019, ISSN: 1544-6123, AIS: 2

Ci5.4 Wang Jiazhen, Jiang Yuexiang, Zhu Yanjian, Yu Jing, *Prediction of volatility based on realized-GARCH-kernel-type models: Evidence from China and the U.S.*, Economic Modelling, Impact Factor: 3,127, Volume 91, Page: 428-444, DOI10.1016/j.econmod.2020.06.004, ISSN: 0264-9993, AIS: 3

Ci6 **Matei Marius**, *Perspectives on risk measurement - a critical assessment of PC-GARCH against the main volatility forecasting models*, Romanian Journal of Economic Forecasting, 2012, Volume 15, Issue 1, Pages 95-115, Impact factor 0,831, ISSN: 1582-6163, WOS:000302395700006

Ci6.1 Acatrinei Marius, Gorun Adrian și Marcu Nicu, *A DCC-GARCH Model to estimate the risk to the capital market in Romania*, Romanian Journal of Economic Forecasting, 2012, Volume 16, Issue 1, pages 136-148, Impact factor 0,831, ISSN: 1582-6163, WOS: 000317313700008, AIS: 4

Ci7 **Matei Marius**, *Assessing volatility forecasting models: why GARCH models take the lead*, Romanian Journal of Economic Forecasting, 2009, Volume 12, Issue 4, Pages 42-65, Impact factor 0,831, ISSN: 1582-6163, WOS:000273227400003

Ci7.1 Nieto Rosa Maria și Carmona-Benitez Bernardo Rafael, *ARIMA plus GARCH plus Bootstrap forecasting method applied to the airline industry*, Journal of Air Transport Management, 2018, Volume: 71, Pages: 1-8, Impact factor: 2.412, ISSN: 0969-6997, DOI: 10.1016/j.jairtraman.2018.05.007, WOS:000441652400001, AIS: 3

Ci7.2 Lupu Radu, *Simultaneity of tail events for dynamic conditional distributions of stock market index returns*, Romanian Journal of Economic Forecasting, 2014, Volume 17, Issue 4, Pages 49-64, Impact factor 0,831, ISSN: 1582-6163, WOS:000347656600003, AIS: 4

Ci7.3 Xiaoqiang Lin și Fangyu Fei, *Long memory revisit in Chinese stock markets: Based on GARCH-class models and multiscale analysis*, Economic Modelling, 2013, Volume 31, Pages 265-275, Impact factor 2.056, ISSN: 0264-9993, WOS: 000316643600031, DOI: 10.1016/j.econmod.2012.11.037 (citarea se poate verifica atât prin Google Scholar, cât și prin consultarea listaei bibliografice de la sfârșitul acestei lucrări), AIS: 3

Ci7.4 Rupande Lorraine, Muguto Hilary Tinotenda și Muzindutsi Paul-Francois, *Investor sentiment and stock return volatility: Evidence from the Johannesburg Stock Exchange*, 2019, Cogent Economics & Finance, Volume: 7, Issue: 1, DOI: 10.1080/23322039.2019.1600233, AIS: nu este in lista UEFISCDI

Ci7.5 Basdekis Charalampos, Christopoulos Apostolos, Gkolfinopoulos Alexandros, Katsampoxakis Ioannis, *VaR as a risk management framework for the spot and futures tanker markets*, 2021, Operational Research, Impact Factor 2,41, DOI10.1007/s12351-021-00673-y, ISSN: 1109-2858, AIS: 4

Ci8 Huang Wen, Huang Zhuo, **Matei Marius** și Wang Tianyi, *Price volatility forecast for agricultural commodity futures: the role of high frequency data*, Romanian Journal of Economic Forecasting, 2012, Volume 15, Issue 4, Pages 83-103, Impact factor 0,831, ISSN: 1582-6163, WOS: 000313533000006; publicatie indexata in Baza ISI

Ci8.1 Zhang Yongli și Na Sanggyun, *A Novel Agricultural Commodity Price Forecasting Model Based on Fuzzy Information Granulation and MEA-SVM Model*, Mathematical Problems in Engineering, 2018, Impact factor: 1,179, Volume 2018, Issue 1, DOI: 10.1155/2018/2540681, AIS: 3

Notă

- (1) Fiecare lucrare este prezentată, în limba în care a fost publicată/expusă, corespunzător structurii “ I, II, III, IV, V, VI, VII ”, unde: I este indicativul (T1, T2 etc.; Ca1, Ca2 etc.; ...), care se scrie “bold” la lucrările realizate după acordarea ultimului titlu didactic/grad profesional(**Ca1, I1** etc., după caz); II - autorii în ordinea din publicație, cu scriere “bold” a **candidatului**; III – titlul, scris “italic”; IV - editura sau revista sau manifestarea și/sau alte elemente de localizare, după caz; V - intervalul de pagini din publicație, respectiv, pp ...-..., numărul total de pagini, respectiv, ... pg., sau alte date similare, după caz; VI - anul sau perioada de realizare, după caz.; VII – ISSN (pentru reviste) sau ISBN (pentru cărți, manuale, tratate, volumele unor manifestări științifice, etc).

- (2) În cadrul fiecărui grup de lucrări (Ca1, Ca2 etc.; I1, I2 etc. ; ...), lucrările sunt în ordine invers cronologică.

Candidat,

.....

INFORMAȚII OBLIGATORII ÎN LISTA DE LUCRĂRI

1. Monografii/cărți de specialitate/manuale/tratate:

Autori (lista completă), titlu, editură, recunoașterea CNCS a editurii în funcție de domeniul științific, an apariție, numărul total de pagini al publicației, numărul de pagini care aparțin candidatului, ISBN.

2. Articole/studii de specialitate publicate în reviste recunoscute din țară și/sau străinătate:

Autori (lista completă), titlu articol/studiu, nume revistă, număr/volum apariție și an, paginile unde se găsește articolul, baza/bazele de date care indexează revista, factorul de impact al revistei, ISSN-ul, identificator digital (DOI), conform standardelor internaționale.

3. Studii/capitole publicate în volume colective sau volumele unor conferințe publicate la o editură din țară sau străinătate:

Autori (lista completă), denumire volum colectiv/conferință, titlu studiu/capitol, denumire conferință, loc și perioadă desfășurare conferință, editură, recunoașterea CNCS a editurii în funcție de domeniul științific, an apariție volum, paginile unde se găsește studiul/capitolul, numărul total de pagini al publicației, numărul de pagini care aparțin candidatului, ISBN/ISSN.

4. Citări ale lucrărilor publicate:

Pentru lucrarea citată și pentru lucrările care citează se va completa cu referințele bibliografice conform punctelor 1, 2, 3.