

Instituția de învățământ superior Academia de Studii Economice  
 Facultatea de Cibernetică, Statistică și Informatică Economică  
 Departamentul de Statistică și Econometrie  
 Poz. Postului 31 Disciplina(e) postului: Econometrie; Econometrie (engleză)

**Fișa de verificare a îndeplinirii standardelor pentru ocuparea  
 postului de CONFERENȚIAR UNIVERSITAR** publicat în  
 Monitorul Oficial al României, partea a III-a, nr. 1242 din  
 03.12.2021

Candidat Marius Matei Data nașterii: 3 Decembrie 1976  
 Funcția actuală: Economist Principal  
 Data numirii în funcția actuală: Iulie 2019  
 Instituția: Banca Națională a României, Departamentul de Stabilitate Financiară

1. *Studiile universitare de licență*

Nr.crt.	Instituția de învățământ superior și facultatea absolvită	Domeniul	Perioada	Titlul acordat
1	Academia de Studii Economice · Facultatea de Relații Economice Internaționale	Tranzacții Internaționale	1995-1999	Licențiat în Economie

2. *Studiile universitare de masterat*

Nr.crt.	Instituția de învățământ superior și programul de masterat absolvit	Domeniul	Perioada	Titlul acordat
1.	Universitatea Carleton · Canada	Economie	2006-2007	Master
2	ESADE Business School   Universitatea Ramon Llull · Spania	Științele Managementului	2007 - 2008	Master în Cercetare
3	Școala Națională de Studii Politice și Administrative	Relații Internaționale și Integrare Europeană	1999-2001	Master

3. *Studiile de doctorat*

Nr.crt.	Instituția organizatoare de doctorat	Domeniul	Perioada	Titlul științific acordat
1	Institutul Național de Cercetări Economice "Costin C. Kirițescu"   Academia Română	Economie	2002-2010	Doctor în Economie
2	ESADE Business School   Universitatea Ramon Llull · Spania	Științele Managementului (Finanțe)   Specializare: Econometrie Financiară	2008 - 2012	Doctor în Științele Managementului

4. *Studii și burse doctorale (stagii de cel puțin 6 luni)*

Nr.crt.	Țara / instituția	Domeniul / specializarea	Perioada	Tipul de bursă
1	Australia / Facultatea de Economie și Afaceri Tasmaniană   Universitatea din Tasmania	Econometrie Financiară	2012-2015	Contract de muncă

2	România / Institutul Național de Cercetări Economice “Costin C. Kirițescu”   Academia Română	Economie	2010-2012	Bursă POSDRU
3	SUA / Universitatea Stanford   Departmentul de Economie	Econometrie Financiară	2010 (3 luni)	Grantul de Mobilitate, Ministerul Educației din Spania
4	Danemarca / Centrul pentru Cercetare în Analiza Econometrică a Seriilor de Timp (CREATES)   Universitatea Århus	Econometrie Financiară	2011 (3 luni)	Bursă POSDRU
5	Marea Britanie / Universitatea Oxford - OMI (Institutul Oxford-Man) - SoFiE (Societatea de Econometrie Financiară) - Școala de Vară în Econometrie Financiară	Econometrie Financiară	2012 (1 săptămână)	Bursă SoFiE (Societatea de Econometrie Financiară)
6	Portugalia / Universitatea NOVA - Școala de vară, ‘Modelarea și Previzionarea Volatilității’	Econometrie Financiară	2009 (1 săptămână)	Bursă Universitatea NOVA
7	Franța / ESSCA (École Supérieure des Sciences Commerciales d’Angers)	Management	2002 (4 luni)	Bursă ESSCA
8	Austria / Universitatea de Științe Economice și Administrarea Afacerilor	Management	1998 (1 lună)	Bursă Wirtschaftsuniversität Wien
9	Franța / Universitatea Aix-en-Provence	Economie	1998 (1 săptămână)	Bursă Universitatea Aix-en-Provence
10	Austria / Wirtschaftsuniversität Wien, Germania / Mannheim University, Belgia / Vlerick Business School Franța / IÉSEG School of Management	Economie	2015	Două Granturi de Călătorie la Conferințe, Facultatea de Economie și Afaceri Tasmaniană   Universitatea din Tasmania (totalizând \$5228)
11	Spania / ESADE Business School	Finanțe	2008-2012	Grant FI, acordat de Generalitat de Catalunya, Spania

##### 5. Grade didactice / profesionale

Nr.crt.	Instituția	Domeniul	Perioada	Titlul / postul didactic sau gradul profesional
---------	------------	----------	----------	---

1.	Institutul Național de Cercetări Economice "Costin C. Kirițescu" al Academiei Române	Economie	Din iulie 2018	Cercetător științific gradul 1
----	---	----------	----------------	--------------------------------------

6. Îndeplinirea obligatorie, în conformitate cu Anexa 1 la Metodologia de concurs, a cerințelor pentru obținerea calificativului FOARTE BINE.

**Punctaj P=49,341>0,75, Punctaj C=17,75>0,5, Punctaj S=67,091>1,5, conform anexelor Calcul punctaj si Calcul punctaj citari. Citarile pot fi consultate in documentul Lista de publicatii, punctul 5.** Un articol publicat în *Journal of Econometrics* (jurnal ISI categoria A\*), un altul publicat în *Journal of International Financial Markets, Institutions & Money*, un altul publicat în *Economic Record* (jurnal ISI categoria A), un altul publicat în *Econometrics* (jurnal ISI categoria A), si patru publicate în *Romanian Journal of Economic Forecasting* (jurnal ISI categoria B). Participari la numeroase conferinte, conform listei de mai jos la rubrica Conferinte / Seminarii.

Curs universitar:

**Matei Marius, " Risk and volatility. Theory, methods and econometric modelling", suport de curs, Editura Economică, 2021, ISBN 978-973-709-989-1**

7. Realizări profesional-științifice

## PUBLICAȚII

- 2020 Examining stress in Asian currencies: A perspective offered by high frequency financial market data / Examinarea stresului în monedele asiatice: o perspectivă oferită de datele financiare eșantionate la intervale mici (autori: Mardi Dungey, Marius Matei și Sirimon Treepongkaruna), *Journal of International Financial Markets, Institutions & Money*, Vol 67 (101200), 1-18  
<https://www.sciencedirect.com/science/article/abs/pii/S1042443120300846>
- 2019 Bivariate volatility modelling with high frequency data / Modelarea bivariată a volatilității cu date eșantionate la intervale mici (autori: Matei Marius, Rovira Xari și Agell Núria, *Econometrics*, 7(3), 41  
[mdpi.com/2225-1146/7/3/41](https://www.mdpi.com/2225-1146/7/3/41)
- 2018 Testing for mutually exciting jumps and financial flights in high frequency data / Testarea salturilor reciproce și a mișcării capitalurilor cu date eșantionate la intervale mici (autori: Dungey Mardi, Erdemlioglu Deniz, Matei Marius și Yang Xiye), *Journal of Econometrics*, Vol 202(1), 18-44  
<https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S0304407617301914>
- 2017 Surfing through the GFC: systemic risk in Australia / Survolând Marea Criză Financiară: riscul sistemic în Australia (autori: Dungey Mardi, Luciani Matteo, Matei Marius și Veredas David), *Economic Record*, Vol 93(300), 1-19  
[https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract\\_id=2617117](https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract_id=2617117)

- 2012 Price volatility forecast for agricultural commodity futures: the role of high frequency data / Previzionarea volatilității contractelor futures ale mărfurilor agricole: rolul datelor eșantionate la intervale mici (autori: Huang Wen, Huang Zhuo, Matei Marius și Wang Tianyi), Romanian Journal of Economic Forecasting, Vol 15(4), 83-103  
[http://www.ipe.ro/rjef/rjef4\\_12/rjef4\\_2012p83-103.pdf](http://www.ipe.ro/rjef/rjef4_12/rjef4_2012p83-103.pdf)
- 2012 Perspectives on risk measurement - a critical assessment of PC-GARCH against the main volatility forecasting models / Perspective în managementul riscului – O evaluare critică a modelului PC-GARCH în comparație cu principalele modele de previziune a volatilității (autor: Matei Marius), Romanian Journal of Economic Forecasting, Vol.15(1), 95-115  
[http://www.ipe.ro/rjef/rjef1\\_12/rjef1\\_2012p95-115.pdf](http://www.ipe.ro/rjef/rjef1_12/rjef1_2012p95-115.pdf)
- 2011 Non-linear volatility modelling of economic and financial time series using high frequency data / Modelarea volatilității neliniare a seriilor economice și financiare de timp cu date cu frecvență mare (autori: Matei Marius), Romanian Journal of Economic Forecasting, Vol. 14(2), 116-141. De asemenea capitol de carte în ‘Non-Linear Modelling in Economics - Beyond Standard Economics’, Expert: București, 2011
- 2009 Assessing volatility forecasting models: why GARCH models take the lead / Evaluarea modelelor de previzionare a volatilității: De ce modelele GARCH conduc (autor: Matei Marius), Romanian Journal of Economic Forecasting, Vol.12(4), 42-65  
[http://www.ipe.ro/rjef/rjef4\\_09/rjef4\\_09\\_3.pdf](http://www.ipe.ro/rjef/rjef4_09/rjef4_09_3.pdf)
- 2013 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
- 2015 Modelling and measuring jumps in high frequency data/ Modelarea și măsurarea salturilor în datele eșantionate la intervale mici (autor: Matei Marius); capitol de carte în ‘Selected issues in macroeconomic and regional modelling: Romania an emerging country in EU / Teme selectate în modelarea macroeconomică și regională: România o țară emergentă în UE’, Nova Science Publishers: NY, 2015  
<http://ecite.utas.edu.au/119454>

## ARTICOLE ÎN LUCRU

- Volatility during the financial crisis through the lens of high frequency data: a Realized GARCH approach / Volatilitatea în perioada crizei financiare văzută din perspectiva datelor cu frecvență mare: O abordare în cadrul modelului Realized GARCH (autori: Bănulescu Georgiana, Hansen Peter Reinhard, Matei Marius și Huang Zhuo) (revise and resubmit la Journal of Banking & Finance)  
[https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract\\_id=3178890](https://papers.ssrn.com/sol3/papers.cfm?abstract_id=3178890)
- Notes on FX global intensities / Note asupra intensităților monedelor globale (autori: Dungey Mardi, Matei Marius și Novotný Jan)

- Impact of illiquidity in identification of financial stress periods: a simulation approach / Impactul lipsei de lichiditate asupra identificării perioadelor de stress financiar: o abordare prin simulație (autori: Dungey Mardi, Matei Marius și Treepongkaruna Sirimon)

## CĂRȚI

- „Techniques of forecasting volatility and returns of high frequency time series. Macromicro binomial from the data aggregation and synthetising perspective” / “Tehnici de prognoză a volatilității și randamentelor seriilor temporale de înaltă frecvență. Binomul macro-micro din perspectiva agregării și sintetizării datelor”, editura Expert, 2013, ISBN 978-973-618-380-5
- „Risk and Volatility (Theory, Methods and Econometric Modelling)” / „Riscul și Volatilitatea (Teorie, Metode și Modelare Econometrică)”, Editura Economică, 2021, ISBN 978-973-709-989-1

## CAPITOLE ÎN CĂRȚI

- 2021 Bivariate Volatility Modelling with High-Frequency Data / Modelarea volatilității bivariate cu date eșantionate la intervale mici | Marius Matei | în ‘Recent Advances in Theory and Methods for the Analysis of High Dimensional and High Frequency Financial Data’, editura MDPI: Basel, ISBN 978-3-0365-0852-8
- 2015 Modelling and Measuring Jumps in High Frequency Data / Modelarea și măsurarea salturilor în datele cu frecvență înaltă | Marius Matei | în ‘Selected Issues in Macroeconomic and Regional Modelling: Romania an Emerging Country in EU’, editura Nova Science Publishers: NY, ISBN 978-1-63484-936-4
- 2011 Non-linear Volatility Modelling of Economic and Financial Time Series Using High Frequency Data / Modelarea volatilității neliniare a seriilor economice și financiare de timp cu date cu frecvență mare | Marius Matei | în ‘Non-Linear Modelling in Economics – Beyond Standard Economics’, Expert: Bucharest, ISBN 978-973-618-260-0

## CONFERINȚE | SEMINARII

**Dungey M., Matei M., Treepongkaruna S., ‘Identifying Periods of Financial Stress in Asian Currencies: The Role of High Frequency Financial Market Data’ / Identificarea perioadelor de stress financiar în monedele Asiatice: rolul datelor financiare cu frecvență mare**

- A 25<sup>a</sup> Întâlnire a Grupului de Studiu în Econometrie al Noii Zeelande, Centrul Național pentru Cercetare în Econometrie, Universitatea de Tehnologie din Queensland, Brisbane, 19-20.02.2015
- Conferința Frontiere în Econometria Financiară - Universitatea de Tehnologie din Queensland, Brisbane, 7-8.08.14

- Conferința ESAM/ACE (Întâlnirea Societății Australasiatice de Econometrie și Conferința Australiană a Economiștilor), Hobart, 1-4.07.2014
- A 4<sup>a</sup> Conferință a Grupului Piețe Financiare Emergente: Finanțele Piețelor Financiare, Cass Business School, City University, Londra, 8-9.05.2014 (unde am fost și discutant al unui articol)
- Conferința Skewness, Heavy Tails, Market Crashes, and Dynamics, Universitatea Cambridge și SoFiE, Cambridge, 28-29.04.2014
- Seminar Departamental la European University Institute, Departamentul de Economie, Florența, 6.5.2014
- Seminarul de Macromodelare, Institutul de Prognoză Economică, Academia Română, București, 13.05.2014

**Matei M., Rovira X. & Agell N. ‘Bivariate Volatility Modelling with High Frequency Data’ / Modelarea bivariată a volatilității cu date eșantionate la intervale mici**

- Întâlnirea Societății Australasiatice de Econometrie, Sydney, 9-12.07.2014
- Conferința Anuală a FIRN (Financial Integrity Research Network), Hobart, 9-11.11.2012
- Întâlnirea Europeană a Societății de Econometrie, Malaga, 27-31.8.2012

**Matei M., ‘Multivariate Volatility Modelling with High Frequency Data’ / Modelarea multivariată a volatilității cu date eșantionate la intervale mici**

- Seminarul Departamental, Centrul pentru Cercetare în Analiza Econometrică a Seriilor de Timp (CREATES), Școala de Economie și Management, Universitatea Århus, Danemarca

Dungey M., Luciani M., Matei M., Veredas D., ‘Surfing through the GFC: Systemic Risk in Australia’ / Survolând Marea Criză Financiară: Riscul Sistemic în Australia

- Conferința de Alocare a Activelor (Asset Allocation) 2016, International Business Review Conference, Sydney, Australia

## **AFILIERI LA PROIECTE DE CERCETARE**

2019 ‘Automatizarea calculului măsurilor de dispersie și asimetrie a distribuțiilor transversale în Matlab’ | Macquarie University | Australia

2017-2019 ‘Modelare financiară cu date de înaltă frecvență criptomonedă’ (cu Prof. George Milunovich) | Macquarie University | Australia

2018 ‘Probleme metodologice ale evaluării PIB potențial în economia României’, Institutul Național de Cercetare Economică “Costin C. Kirițescu” al Academiei Române

2014 - 2015 ‘Detectarea riscului sistemic’, acordat de CIFR (Australian Centre for International Finance and Regulation) (împreună cu Prof. Mardi Dungey, Prof. David Veredas și Dr. Matteo Luciani), Australia

2012 - 2014 ‘Detectarea contagiunii financiare cu date eșantionate la intervale mici’, acordat de Australian Research Council (împreună cu Prof. Mardi Dungey și Prof. Sirimon Treepongkaruna), Australia

2012 ‘Modelul structural HEROM’ – CEROPÉ și Institutul Național de Cercetare Economică, Academia Română, România și Institutul de Cercetare Structurală, Polonia

2012 ‘Studii de teorie și aplicații ale modelelor de volatilitate și corelație bazate pe cadrul Realized GARCH’ – cu Zhuo Huang, Școala Națională de Dezvoltare, Universitatea Beijing, China

2011 ‘Noutăți în previzionarea volatilității cu date eșantionate la intervale mici. O nouă evaluare și comparare a modelelor’, ESADE Business School, Universitatea Ramon Llull, Spania

2009 - 2012 ‘Raportare financiară, structura acționariatului și prețuri la Bursa Spaniolă de Schimb’, Research Project ECO2008 - 05218, ESADE Business School, Universitatea Ramon Llull, Spania

2010 - 2012 ‘Revizuirea macro-modelului Dobrescu al economiei românești’ - Institutul Național de Cercetare Economică, Academia Română, România

2009 - 2010 ‘Metodologii de analiză a riscului și incertitudinii, reguli de decizie, metode și modele statistico-matematice, măsuri cantitative ale riscului și incertitudinii’ – Institutul Național de Cercetare Economică “Costin C. Kirițescu”, Academia Română, București

## **GRANTURI**

2014 Două Granturi de Călătorie la Conferințe, Facultatea de Economie și Afaceri Tasmaniană | Universitatea din Tasmania (totalizând \$5228)

2013 Bursă a Institutului CFA

2009 - 2012 Grant FI, acordat de Generalitat de Catalunya, Spania

2009 Grantul de Mobilitate, Ministerul Educației din Spania

2007 - 2008 Bursă ESADE, ESADE Business School, Spania

2006 - 2007 Bursă de achitare a taxelor de școlarizare, Universitatea Carleton, Canada

2006 - 2007 Bursă departamentală, Universitatea Carleton, Canada

2006 - 2007 Contract de predare a seminariilor, Universitatea Carleton, Canada

2002 Contract de predare a seminariilor, École Supérieure des Sciences Commerciales d'Angers, France

1998 Bursă, Universitatea de Științe Economice și Administrarea Afacerilor, Austria

1995 - 1997 Bursă de Studiu, Academia de Studii Economice, Facultatea de Relații Economice Internaționale, România

### **ACTIVITATE EDITORIALĂ | AFILIERI PROFESIONALE**

in 2016 Centrul de Modelare Macroeconomică al Institutului Național de Cercetare Economică "Costin C. Kirițescu" al Academiei Române - Cercetător asociat

2013 European Journal of Operational Research - Referent

2014 Computational Management Science - Referent

2014 Australian Journal of the Agricultural and Resource Economics - Referent

2016 Journal of Contemporary Accounting and Economics - Referent

Din 2011 Romanian Journal of Economic Forecasting - Membru al Boardului Editorial

Din 2012 The Econometric Society - Membru

Din 2014 European Economics Association - Membru

Din 2014 European Finance Association - Membru

2008-2012 ESADE Business School, Ramon Llull University, Barcelona, Spain - Membru al:

Group for Research in Economics and Finance (GREF)

Research Group on Knowledge Engineering (GREC)



## ACTIVITĂȚI DE MENTORAT

Sayeed Mohammad | Facultatea de Economie și Afaceri Tasmaniană | Universitatea din Tasmania

**Atasez acestei Fișe o anexa cu articolele și cărțile publicate, precum și citările aferente acestora, însoțite de adresele web la care pot fi accesate.**

Table 1

Calcul punctaj											
Nr.	Articol	Jurnal	Autori	Anul publicat	M	N	AIS	Pi	Nr. de citari (autocitarile și semiautocitarile)		Ci
1	Testing for Mutually Exciting Jumps and Financial Flights in High	Journal of Econometrics	Dungey Mardi, Erdemlioglu Deniz, Matei Marius & Yang Xiye	2018	10	0	2.726	29.986	6		5
2	Examining Stress in Asian Currencies: A Perspective Offered by High	Journal of International Financial Markets, Institutions & Money	Dungey Mardi, Matei Marius & Treepongkaruna Sirimon	2020	10	1	0.904	9.04	2		1.25
3	Surfing through the GFC: Systemic	Economic Record	Dungey Mardi, Luciani Matteo, Matei Marius	2017	10	0	0.442	4.862	9		6.75
4	Bivariate Volatility Modelling with High Frequency Data	Econometrics	Matei Marius, Rovira Xari și Agell Xari	2019	10	1	nu apare în lista UEFSCI de calcul a AIS	0	0		0.75
5	Price Volatility Forecast for Agricultural Commodity Futures: The Role of High	Romanian Journal of Economic Forecasting	Matei Marius, Huang Wen, Huang Zhuo & Wang Tianyi	2012	10	0	0.133	1.463	1		0.5
6	Perspectives on Risk Measurement - A critical Assessment of PC-GARCH Against the Main Volatility Forecasting	Romanian Journal of Economic Forecasting	Matei Marius	2012	10	1	0.133	1.33	1		0.25
7	Non-linear Volatility Modelling of Economic and Financial Time Series Using High Frequency	Romanian Journal of Economic Forecasting	Matei Marius	2011	10	1	0.133	1.33			
8	Assessing Volatility Forecasting Models: Why GARCH Models Take	Romanian Journal of Economic Forecasting	Matei Marius	2009	10	1	0.133	1.33	4		1.5
9	Tehnici de Previzionare a Volatilității și Randamentelor Seriilor de Time Series Data	Carte publicata la Editura Expert	Matei Marius	2013							
10	Modelling and measuring jumps in high frequency data/ Modelarea și măsurarea salturilor în datele eșantionate la intervale mici	Capitol de carte publicat în volumul 'Selected issues in macroeconomic and regional modelling: Romania an emerging country in EU / Teme selectate în modelarea macroeconomică și regională: România o țară emergentă în UE', Nova Science Publishers: NY, 2015	Matei Marius	2015							
11	Non-linear volatility modelling of economic and financial time series using high frequency data / Modelarea volatilității neliniare a seriilor economice și	Capitol de carte publicat în volumul 'Non-Linear Modelling in Economics - Beyond Standard Economics', Expert: București, 2011	Matei Marius	2011							
12	Volatility during the financial crisis through the lens of high frequency data: a	Working paper	Banulescu, G.-D., Hansen, P.R., Huang, Z., Matei, M	2015					1		1.75
							<b>Sum</b>	<b>49.341</b>			<b>17.75</b>
								<b>P=P1+P2+P3+P4+P5+P6+P7+PR</b>			<b>C=sum(Ci)</b>
							<b>S=P+C</b>		<b>67.091</b>		

Calcul punctaj citari

Testing for Mutually Exciting Jumps and Financial Flights in High Frequency Data

	Ci	Examining Stress in Asian Currencies: A Perspective Offered by High Frequency Financial Market Data	Ci	Surfing through the GFC: Systemic Risk in Australia	Ci	Bivariate Volatility Modelling with High Frequency Data	Ci	Price Volatility Forecast for Agricultural Commodity Futures: The Role of High Frequency Data	Ci	Perspectives on Risk Measurement - A critical Assessment of PC-GARCH Against the Main Volatility Forecasting Models	Ci	Assessing Volatility Forecasting Models: Why GARCH Models Take the Lead	Ci	Volatility during the financial crisis through the lens of high frequency data: a realized GARCH approach	Ci	
AIS	Puncte	AIS	Puncte	AIS	Puncte	AIS	Puncte	AIS	Puncte	AIS	Puncte	AIS	Puncte	AIS	Puncte	
	2	0.75	4	0.25	3	0.5	2	0.75	3	0.5	4	0.25	3	0.5	3	0.5
	1	1	1	1	3	0.5					4	0.25	2	0.75		
	2	0.75			3	0.5					3	0.5	3	0.5		
	2	0.75			2	0.75					4	0.25				
	4	0.25			3	0.5										
	3	0.5			1	1										
	1	1			3	0.5										
					2	0.75										
					3	0.5										
					4	0.25										
					3	0.5										
					3	0.5										
SUM	5		1.25		6.75		0.75		0.5		0.25		1.5		1.75	