

Codruț-Florin Ivașcu

📍 Acasă : Bucharest, România

✉ E-mail:

☎ Telefon:

DESPRE MINE

Pasionat de Data Science, Finanțe, Machine Learning, Risk Management and Piețe de Capital.

EXPERIENȚA PROFESIONALĂ

Deloitte

[09/2022 – În curs] Senior Consultant - Risk Advisory

Membru în echipa de cercetare în Machine Learning

Am dezvoltat diverse modele avansate de machine learning pentru evaluarea riscurilor de credit, inclusiv modele de Probability of Default (PD) și Loss Given Default (LGD), Scorecards și Early Warning Systems (EWS).

Am implementat modele LGD conforme cu A-IRB și IFRS9 folosind Python și PySpark pe infrastructura AWS pentru o bancă sistemică majoră din Marea Britanie.

Am creat aplicații web pentru validarea modelelor și Early Warning Systems folosind Streamlit și FastAPI, punând accentul pe accesibilitatea și interacțiunea cu utilizatorul.

Am realizat modelarea riscurilor climatice pentru un consorțiu de bănci nordice, oferind informații despre impactul politicilor climatice asupra pieței de capital.

Academia de Studii Economice

[01/2022 – 12/2024] Asistent de Cercetare

Membru în departamentul de Monedă

Am publicat în reviste de top în domeniul finanțelor

Reviewer și Asistent Editorial pentru revista The Review of Finance and Banking

Bucharest University of Economic Studies

[10/2021 – În curs] Profesor Asociat

Am ținut seminarii în inginerie financiară și modelare

Algotech Innovation

[02/2018 – 08/2022] Quantitative Research Analyst

Am realizat cercetări cantitative detaliate pe piețele de mărfuri (futures) și am dezvoltat algoritmi avansați de pair trading folosind Python.

Am fost implicat în întregul ciclu de viață al dezvoltării modelelor, inclusiv pregătirea datelor, analiza, backtesting-ul și implementarea, asigurând strategii de trading robuste și profitabile.

Am dezvoltat o aplicație de robo-advisory pentru trading automatizat ce se integrează cu diverse platforme de brokeraj pentru a îmbunătăți eficiența execuției tranzacțiilor.

Am monitorizat și rafinat continuu modelele de trading pe baza datelor în timp real, îmbunătățind randamentele ajustate la risc și asigurând alinierea cu obiectivele de investiții ale fondului de hedging.

Uniqa Life S.A.

[10/2016 – 02/2018] Actuar Junior

Am fost responsabil de calculul actuarial privind asigurările de viață și de raportarea analizei indicatorilor financiari și a rezultatelor către board.

EDUCAȚIE ȘI FORMARE PROFESIONALĂ

- [2019 – 2025] **Ph.D. în Finanțe Cantitative**
Academia de Studii Economice
Lucrarea de diplomă: Machine Learning aplicat în Finanțe
- [2020 – 2022] **Modul Pedagogic și de Psihologie**
Academia de Studii Economice
Cursuri cheie: didactică, psihologie, pedagogie, management organizațional
- [2017 – 2019] **Master în Finanțe Cantitative**
CEFIN, Academia de Studii Economice
Lucrarea de diplomă: Option pricing folosind Machine Learning
Cursuri cheie: calcul stochastic, econometrie avansată, statistică și probabilități
- [2014 – 2017] **Licență în Finanțe**
FABBV, Academia de Studii Economice
Lucrarea de diplomă: Modelarea structurii la termen a ratelor dobânzii
Cursuri cheie: inginerie financiară, finanțe corporative, finanțe publice, piețe de capital, monedă și instituții de credit

COMPETENȚE

Microsoft Office | Python | SQL | EViews | Web App Development | PySpark

PUBLICAȚII

Gestiunea Portofoliului

- Ivașcu, C. F. (2021). Option pricing using machine learning. *Expert Systems with Applications*, 163
- Ivașcu, C. F. (2022). Heuristic methods for stock selection and allocation in an index tracking problem. *Algorithmic Finance*, 9(3-4), 103-119.
- Ivașcu, C. F. (2023). Understanding Dividend Puzzle Using Machine Learning. *Computational Economics*, 1-19.

Modelare Economică

- Ivașcu, C. F., & Ștefoni, S. E. (2023). Modelling the non-linear dependencies between government expenditures and shadow economy using data-driven approaches. *Scientific Annals of Economics and Business*, 70(1), 97-114.
- Ivașcu, C. (2023). Can Machine Learning Models Predict Inflation?. In *Proceedings of the International Conference on Business Excellence* (Vol. 17, No. 1, pp. 1748-1756).

Risk Management

- Modelling Credit Risk in a Low Default Portfolio Setting with ML - in review - best paper at FIBA conference 2024
- Ivașcu, C. F., & Serban, D. (2023). Value at Risk estimation for non-gaussian distributions. *Review of Finance & Banking*, 15(2).

VOLUNTARIAT

- [2015 – 2019] **Business Development Officer** Voluntari pentru Idei si Proiecte (VIP) - ONG studențesc
Membru și Alumnus al Econosofia. Organizator al proiectului Investment School, ediția a 15-a.
- [2014 – 2015] **Marketing and Research Officer** DaAfaceri - ONG studențesc
Organizator al proiectelor Actori la Bursa, Resume și BusinessIntro