

ANUNȚ

Academia de Studii Economice din București organizează proces de recrutare și selecție pentru ocuparea a **doua** posturi de **Cercetător postdoctorand 8 / Cercetător postdoctorand 9** în cadrul proiectului „*Procese auto-similare non-Gaussiene: Îmbunătățirea instrumentelor matematice și a modelelor financiare pentru a surprinde dinamica complexă a pieței*”, cod proiect **194/31.07.2023**

Contractul individual de muncă este cu timp parțial de maxim **42 ore/lună** distribuite inegal în funcție de activitățile proiectului

Salariul orar brut este de **96,60 lei/ora**.

Contractul individual de muncă se încheie pe perioadă determinată până la data de **30.06.2026**

A. Pentru participarea la procesul de recrutare și selecție, candidații trebuie să îndeplinească următoarele condiții generale și condiții specifice:

1. Condiții generale:

- a) are cetățenia română, cetățenie a altor state membre ale Uniunii Europene, a statelor aparținând Spațiului Economic European și/sau străini astfel cum sunt ei definiți de art 2 lit. a) din OUG 194/12.12.2002 cu modificările și completările ulterioare, respectiv persoane care nu au cetățenia română, cetățenia unui alt stat membru al UE ori cetățenia Confederației Elvețiene;
- b) are vârsta minimă reglementată de prevederile legale;
- c) are capacitate deplină de exercițiu;
- d) are o stare de sănătate corespunzătoare postului pentru care candidează;
- e) îndeplinește condițiile de studii și, după caz, de vechime sau alte condiții specifice potrivit cerințelor postului scos pentru care se desfășoară procesul de recrutare și selecție;
- f) nu a fost condamnat(ă) definitiv pentru săvârșirea unei infracțiuni contra umanității, contra statului ori contra autorității, de serviciu sau în legătură cu serviciul, care împiedică înfăptuirea justiției, de fals ori a unor fapte de corupție sau a unei infracțiuni săvârșite cu intenție, care ar face-o incompatibilă cu exercitarea funcției, cu excepția situației în care a intervenit reabilitarea.

2. Condiții specifice:

- a) nivelul studiilor: superioare finalizate cu diplomă de doctor
- b) candidatul la data apelului (26/06/2023), deține o diplomă de doctor și avea experiență în cercetare de cel mult 8 ani echivalent normă întreagă, de la data primei diplome de doctorat, dar fără a depăși 10 ani echivalent normă întreagă în condiții prevăzute de Agenția Executivă Europeană pentru Cercetare (REA)
- c) domeniul studiilor: ramura de știință

- științe economice, domeniul relații economice internaționale

d) Alte condiții specifice:

Experiență de cercetare în utilizarea metodelor cantitative (statistică, econometrie, analiză de serii de timp) în domeniul interdisciplinare finanțe–marketing, aplicate piețelor și produselor financiare, inclusiv în evaluarea riscului și a comportamentului investitorilor / clienților. Experiența în marketing financiar (analiza comportamentului investitorilor clienților pentru produse de investiții și asigurări, segmentare și testarea reacției pieței la risc și randament), precum și participarea anterioară în proiecte de cercetare interdisciplinare finanțe–marketing va fi considerată un avantaj.

Abilități/Certificări:

Abilități

1. Abilități tehnice:

- Utilizarea, la nivel avansat, a instrumentelor și softurilor de modelare econometrică E-views/Stata/SPSS
- Capacitatea de a dezvolta și implementa modele financiare complexe.
- Înțelegere solidă a teoriilor financiare și a instrumentelor financiare.

2. Abilități analitice:

- Capacitatea de a analiza și interpreta date complexe, de a identifica tendințe și de a formula recomandări bazate pe analize.

3. Abilități de comunicare:

- Excelente abilități de comunicare scrisă și verbală, pentru a prezenta rezultatele cercetării în mod clar și concis.

4. Lucru în echipă:

- Capacitatea de a lucra eficient într-o echipă interdisciplinară, colaborând cu alți cercetători pentru a atinge obiectivele proiectului.

Cerinte specifice

1. Limbi Străine:

- Cunoștințe avansate în limba engleză (scris cât și vorbit) pentru a putea accesa și disemina cunoștințele din literatura de specialitate internațională. Se considerată un avantaj existența unui certificat care să ateste aceste cunoștințe

2. Publicații și contribuții științifice:

- Candidații trebuie să demonstreze că au contribuții și publicații în domeniul statisticii și modelării stocastice în finanțe, managementul riscului, marketing în domeniul financiar care să demonstreze expertiza și capacitatea de cercetare. Se considerată un avantaj dacă candidații demonstrează că au publicațiile în modelarea stocastică non-Gaussiană în finanțele matematice, în reviste relevante pentru comunitatea științifică,

3. Capacitate de inovare:

- O atitudine inovatoare și gândire creativă pentru a dezvolta noi metode și instrumente.

4. Etica în cercetare:

- Înțelegere profundă a principiilor etice în cercetare și angajament față de integritate academică.

5. Disponibilitate pentru Dezvoltare Profesională:

- Disponibilitatea de a participa la conferințe, workshop-uri și alte forme de dezvoltare profesională continuă.

6. Flexibilitate și Adaptabilitate:

- Capacitatea de a se adapta la schimbările de direcție ale proiectului și de a răspunde la provocările neașteptate.

Candidații vor prezenta un portofoliu de proiecte anterioare și publicații științifice relevante pentru a evalua calitatea și relevanța experienței lor, ținând cont de abilitățile și cerințele solicitate.

B. Procesul de recrutare și selecție va consta în:

1. Evaluarea dosarelor de selecție

2. Interviu: interviu structurat

- *data și ora desfășurării interviului:* se vor comunica concomitent cu afișarea rezultatelor la evaluarea dosarelor de selecție;
- *locul desfășurării interviului:* se va comunica concomitent cu afișarea rezultatelor la evaluarea dosarelor de selecție.

Probele sunt eliminatorii, punctajul minim obținut la fiecare probă fiind de 50 de puncte.

C. Tematica și bibliografia:

1. Tematica:

1.1. Fundamentele modelării stocastice în finanțe:

Principiile și tehnicile fundamentale ale modelării stocastice, explorându-se aplicabilitatea acestora în analiza și predicția piețelor financiare.

1.2. Tehnici avansate în modelarea stocastică pentru evaluarea activelor financiare:

Studiul tehnicilor avansate de modelare stocastică (model Gaussian și non-Gaussian) în finanțele matematice cu accent pe dinamica prețului activelor financiare.

1.3. Risc și incertitudine în modelele stocastice:

Analiza modului în care modelele stocastice Gaussiene și non-Gaussiene pot cuantifica și gestiona riscul și incertitudinea în piețele financiare

1.4. Modelarea volatilității și corelațiilor din piețe folosind procese stocastice:

Explorarea utilizării proceselor stocastice Gaussiene și non-Gaussiene în modelarea volatilității și a corelațiilor între instrumentele financiare.

2. Bibliografia:

2.1 Cărți:

Fractals and scaling in finance

Mandelbrot, Benoit B.

Sel. Works B. B. Mandelbrot

Springer-Verlag, New York, 1997, x+551 pp.

ISBN: 0-387-98363-5

MR2502480 - Option pricing in fractional Brownian markets

Rostek, Stefan

Lecture Notes in Econom. and Math. Systems, 622

Springer-Verlag, Berlin, 2009, xiv+137 pp.

ISBN: 978-3-642-00330-1

MR4485442 - Continuous time processes for finance—switching, self-exciting, fractional and other recent dynamics

Hainaut, Donatien

Bocconi Springer Ser., 12

Springer, Cham; Bocconi University Press, [place of publication not identified], 2022, xviii+345 pp.

ISBN: 978-3-031-06360-2; 978-3-031-06361-9

MR1422250 - Introduction to stochastic calculus applied to finance

Lamberton, Damien; Lapeyre, Bernard

Chapman & Hall, London, 1996, xii+185 pp.

ISBN: 978-1-58488-626-6

Python for Data Analysis

Wes McKinney.

(O'Reilly). 2022 Wes McKinney,

ISBN: 978-1-098-10403-0

Python for Finance: Mastering Data-Driven Finance

Yves Hilpisch.

O'Reilly Media, Edition. 2nd, 2019.

ISBN: 978-1492024330.

Mastering Python for Finance: Implement advanced state-of-the-art financial statistical applications using Python, 2nd Edition

James Ma Weiming.

Packt Publishing, 2019.

ISBN: 978-1789346466.

2.2 Article:

MR4028644 - Pricing derivatives in Hermite markets

Stoyanov, Stoyan V.; Rachev, Svetlozar T.; Mittnik, Stefan; Fabozzi, Frank J.

Int. J. Theor. Appl. Finance 22 (2019), no. 6, 1950031, 27 pp.

MR4577885 - Volatility is rough

Gatheral, J.; Jaisson, T.; Rosenbaum, M.

World Sci. Lect. Notes Finance, 6
World Scientific Publishing Co. Pte. Ltd., Hackensack, NJ, 2023, 127–172.

Fractional Brownian motion with zero Hurst parameter: a rough volatility viewpoint

Neuman, Eyal; Rosenbaum, Mathieu

Electron. Commun. Probab. **23** (2018), Paper No. 61, 12 pp.

MR4698114 - Short-Time Asymptotics for Non-Self-Similar Stochastic Volatility

Models

Giorgio, Giacomo; Pacchiarotti, Barbara; Pigato, Paolo

Appl. Math. Finance **30** (2023), no. 3, 123–152.

Local volatility under rough volatility

Bourgey, Florian; De Marco, Stefano; Friz, Peter K.; Pigato, Paolo

Math. Finance **33** (2023), no. 4, 1119–1145.

Markovian approximations of stochastic Volterra equations with the fractional kernel

Bayer, Christian; Breneis, Simon

Quant. Finance **23** (2023), no. 1, 53–70.

Stationary Heston model: calibration and pricing of exotics using product recursive quantization

Lemaire, Vincent; Montes, Thibaut; Pagès, Gilles

Quant. Finance **22** (2022), no. 4, 611–629.

Fractional stochastic volatility correction to CEV implied volatility

Kim, Hyun-Gyoon; Kwon, Se-Jin; Kim, Jeong-Hoon Quant. Finance **21** (2021), no. 4, 565–574.

The overdamped generalized Langevin equation with Hermite noise

Tudor, Ciprian A.

Fract. Calc. Appl. Anal. **26** (2023), no. 3, 1082–1103.

D. Componenta dosarului care trebuie depus de candidați:

1. Opis;
2. Cerere de înscriere la procesul de recrutare și selecție adresată Rectorului ASE;
3. Copia actului de identitate sau orice alt document care atestă identitatea, potrivit legii, după caz;
4. În cazul în care candidatul și-a schimbat numele, copii după documente care atestă schimbarea numelui - certificat de căsătorie sau dovada schimbării numelui;
5. Cazierul judiciar sau o declarație pe propria răspundere că nu are antecedente penale care să-l facă incompatibil cu funcția pentru care candidează.
6. Adeverința medicală care să ateste starea de sănătate corespunzătoare eliberată cu cel mult 6 luni anterior derulării procesului de recrutare și selecție de către medicul de familie al candidatului sau de către unitățile sanitare abilitate, sau declarația pe propria răspundere, cu obligația de a completa dosarul de candidatură cu adeverința medicală

cel mai târziu până la data desfășurării primei probe a procesului de recrutare și selecție, dacă este cazul.

7. Declarația pe propria răspundere, dacă persoana care candidează are/nu are soț/soție sau rude și afini, până la gradul al III-lea inclusiv, care sunt salariați ai Academiei de Studii Economice din București aflați într-o poziție de conducere, control, autoritate cu postul scos în cadrul procesului de recrutare și selecție și nici postul, la care aplică, nu se află într-o poziție de conducere, control, autoritate cu soțul/soția sau rude și afini, până la gradul III inclusiv, salariați ai Universității;
8. Declarație pentru prelucrarea datelor cu caracter personal
9. Curriculum vitae în format european ([www.cveuropean.ro/cv- online.html](http://www.cveuropean.ro/cv-online.html)) – semnat și datat pe fiecare pagină;
10. Copiile documentelor care să ateste nivelul studiilor efectuate și ale altor acte care atestă efectuarea unor specializări, precum și copiile documentelor care atestă îndeplinirea condițiilor specifice prevăzute pentru ocuparea postului, menționate la Cap. A, punct 2.

E. Date de contact:

Dosarele de candidatură se vor depune în format letric, în data de **10.03.2026**, în intervalul orar 08h00-16h00, la Registratura ASE, din Clădirea “Ion Angelescu”, str. Căderea Bastiliei, parter, camera 0016 sau online la adresa de email a persoanei de contact

Persoană de contact:

- Maria Cristina Pădure, SMPFN – e-mail: cristina.padure@ase.ro

Pentru informații referitoare la procesul de recrutare și selecție: e-mail: dru@ase.ro

Modelele de formulare solicitate se pot găsi pe website-ul Serviciului Managementul Proiectelor cu Finanțare Nerambursabilă, secțiunea Resurse, accesând linkul <https://fondurieuropene.ase.ro/resurse/>.

F. Calendarul de recrutare și selecție:

Nr. crt.	Activități	Data
1.	Publicarea anunțului	02.03.2026
2.	Depunerea dosarelor de către candidați la Registratura ase / online la adresa e-mail: cristina.padure@ase.ro	10.03.2026
3.	Selecția dosarelor de către membrii comisiei	11. 03.2026 -12.03.2026
4.	Afișarea rezultatelor selecției dosarelor	13.03.2026
5.	Depunerea contestațiilor privind rezultatele selecției dosarelor	16.03.2026
6.	Afișarea rezultatului soluționării contestațiilor	17.03.2026
7.	Susținerea interviului	18.03.2026
8.	Comunicarea rezultatelor după susținerea interviului	19.03.2026
9.	Depunerea contestațiilor privind rezultatul interviului	20.03.2026
10.	Afișarea rezultatului soluționării contestațiilor	23.03.2026

11.	Afișarea rezultatului final al procesului de recrutare și selecție	23.03.2026
12.	Numire pe funcție	După aprobarea CA