

CURRICULUM VITAE DI ROSELLA GIACOMETTI

POSIZIONI LAVORATIVE

1/2/2021 a oggi Professore ordinario in servizio presso l'Università degli Studi di Bergamo, settore SECS-S06,
1/11/2001 a 31/1/2021, Professore associato in servizio presso l'Università degli Studi di Bergamo, settore SECS-S06, confermata nel 2003.
1/10/1996-2000: Ricercatrice presso l'Università degli Studi di Bergamo, settore SECS-S06, confermata nel 1999.
1990-1992 Analista presso la Società Sirio Informatica di Bergamo.

FORMAZIONE

2019 Bootcamp: training program in Advanced Risk and Portfolio Management (ARPM) New York 12-17 Agosto, 2019

Dottorato di Ricerca (VIII ciclo, 1992-1995) in 'Matematica per l'analisi dei mercati finanziari' presso l'Università degli Studi di Brescia, Dipartimento di Metodi Quantitativi. Titolo della tesi di Dottorato: "Un modello per le emissioni ottimali di titoli sensibili alle variazioni del tasso di interesse".

M.Sc. in "Statistics and Operational Research" (anno accademico 1993/94) presso L'Università di Essex, Colchester, UK. Titolo della tesi: "On optimal design of puttable bonds".

Laurea in Scienze dell'Informazione conseguita il 21/12/1990 presso l'Università degli Studi di Milano, con la votazione finale di 108/110. Titolo della tesi: "Gestione ottima di un processo industriale in presenza di scarse risorse".

Congedo straordinario per motivi di studio ai sensi dell'art. 2 della L. 476/84, della L. 349/58 e art.4 L.498/92 (senza assegni). (D.R. 533/E 30/09/1997) dal 01/10/1997 al 30/09/1998.

Autorizzata a dedicarsi ad esclusiva attività di ricerca scientifica, ai sensi dell'art. 17, del D.P.R. 382/1980. (D.R. 10166/V/012 15/05/2009) dal 01/10/2009 al 30/09/2010

BORSE DI STUDIO

Vincitrice della Borsa di Studio finanziata dalla Banca Popolare di Bergamo per l'anno 1992 (27/2/92 votazione di 60/60) finalizzata allo svolgimento di attività di ricerca presso il dipartimento di Matematica, Statistica, Informatica ed Applicazioni dell'Università di Bergamo.

Vincitrice della Borsa di studio di IMI-SIGECO (1995-1996) per lo sviluppo di un modello per la gestione di un portafoglio di titoli e contratti repo nell'ambito del progetto "Real-time trading analytics for the new Italian market" finanziata dalla IMI-SIGECO.

Vincitrice della Borsa di studio messa a concorso per l'anno 1990/91 dall'amministrazione comunale di Brembate di Sopra.

FELLOWSHIP

Dal 2018 al 2021 Technical University of Ostrava, Faculty of Economics Department of Finance.

VISITING PRESSO UNIVERSITA' ESTERE

2014-15 e 2015-16: School of Business, University of Washington Bothell, Seattle (USA) (20/7/2015-21/8/2015 e 22/07/2016 – 18/8/2016 2016). Attività di ricerca e didattica.

1/3/2012-30/5/2012: Applied Mathematics Departments Stony Brooks University, New York (USA). Attività di ricerca.

8/2/2011 31/3/2011: Università Lumière Lyon 2,(Francia) nell'ambito del progetto Minerva (Febbraio 2010). Attività di ricerca e didattica.

2/11/2009 13/11/2009: University of Cyprus, Department of Public and Business Administration, Cyprus University , Attività di ricerca.

DIDATTICA

ATTIVITA' DIDATTICA IN ITALIA E ALL'ESTERO

UNDERGRADUATE E VECCHIO ORDINAMENTO

Dal 2001 al 2009 (2001-02,2002-03,2003-04,2004-05,2005-06,2006-07,2007-08,2008-09) "Metodi matematici per l'economia e la finanza (**Matematica Finanziaria**)", (24 ore - Insegnamento in Italiano)

Dal 2010 a oggi (2010-11,2011-12,2012-13,2013-14,2014-15,2015-16,2016-17,2017-18,2018-19,2019-20)"**Matematica Finanziaria**", corso nella Laurea Triennale in Economia Aziendale, classe L-18, (6 crediti- Insegnamento in Italiano), Università degli studi di Bergamo. Docente responsabile del corso.

Dal 2001 al 2009 (2001-02,2002-03,2003-04,2004-05,2005-06,2006-07,2007-08,2008-09)e 2011-2012 e 2012-13 ("Statistica dei mercati Monetari e Finanziari (3 crediti- Insegnamento in Italiano), Università degli studi di Bergamo. Docente responsabile del corso.

2014-15 e 2015-16: " Financial modeling with excel " (5 crediti- Insegnamento in Inglese), University of Washington Bothell (USA). Docente responsabile del corso.

Dal 2006 al 2009 (2006-07,2007-08,2008-09) "Elementi di matematica", Laurea Triennale di Scienza della Sicurezza Economico e Finanziaria (24 ore - Insegnamento in Italiano) Università degli studi di Bergamo (Contratto 18970/XIII/25 02/10/2006, Contratto 16144/XIII/31 12/07/2007, Contratto 15686/XIII/25 23/07/2008). Docente responsabile del corso.

2004-05,2005-06: "Informatica per la Finanza" Laurea Triennale in Informatica e Comunicazione per la Finanza e l'impresa", 6 cfu - Insegnamento in Italiano) Università degli studi di Bergamo; Docente responsabile del corso.

2003-04,2004-05 Matematica per le applicazioni economiche" Laurea Triennale di Scienza della Sicurezza Economico e Finanziaria (18 ore - Insegnamento in Italiano) Università degli studi di Bergamo; (Contratto 19547/XIII/25 13/10/2003 Contratto 5422/XIII/25 25/03/2004 Contratto 13716/XIII/25 29/07/2004).

2000-2001 "Matematica finanziaria II A".(20 h- Insegnamento in Italiano), corso del V.O. Laurea in Economia e Commercio. Università degli studi di Bergamo;(Contratto 1500 15/11/2000). Responsabile Prof.ssa Bertocchi, modulo di "Teoria del portafoglio".

1999-2000 Collaborazione al progetto “contratto studenti a tempo pieno” per l'area disciplinare matematica finanziaria presso la facoltà di economia dell'università dell'Insubria, Varese, sotto la guida del responsabile del corso prof.ssa De Giuli

2001-02,2002-03, 2003-04 “Modelli matematici per I mercati finanziari” corso del V.O. Laurea in Economia e Commercio. (70 h- Insegnamento in Italiano), Università degli studi di Bergamo; (Contratto 7230/XIII/31 18/10/2001, Contratto 9277/XIII/31 27/11/2001) . Docente responsabile del corso.

1999-00, “Modelli matematici per I mercati finanziari I” corso del V.O. Laurea in Economia e Commercio. (35 h- Insegnamento in Italiano), Università degli studi di Bergamo;) . Docente responsabile del corso.

1998-1999 “Modelli matematici per I mercati finanziari” (35 ore- Insegnamento in Italiano) . corso del V.O. Laurea in Economia e Commercio.Università degli studi di Bergamo (Supplenza a titolo gratuito Nota rett. 57266 26/11/1998). Responsabile Prof.ssa Bertocchi.

1994-1995 Svolgimento delle esercitazioni nel corso di “Matematica Finanziaria I” presso la Facoltà di Economia dell'Università di Bergamo, sotto la guida del responsabile del corso prof.ssa Bertocchi

1994-1995 “Fondamenti di informatica” (64 h- Insegnamento in Italiano) Università degli studi di Bergamo, Facoltà di Ingegneria. Docente responsabile del corso.

SPECIALISTICA/MAGISTRALE

2019-2020 Responsabile del **Bootcamp ARPM** On campus presso l'università di Bergamo. Erogazione di un corso di 6 settimane tra Ottobre e dicembre 2019 e di un corso di 12 settimane tra Marzo 2020 e Giugno 2020

2012-oggi (2012-13,2013-14,2014-15,2015-16,2016-17,2017-18,2018-19,2019-20): " **Credit and operational risks management.**", Laurea Magistrale in International Management, Entrepreneurship and Finance. (6 crediti- Insegnamento in Inglese), Università degli studi di Bergamo . Docente responsabile del corso.

Dal 2011 a oggi (2011-12,2012-13,2013-14,2014-15,2015-16,2016-17,2017-18,2018-19,2019-20) "**Misurazione del rischio di credito e rischio operativo**", Laurea Magistrale in Management, Finanza e International Business Classe LM-77 (6 crediti- Insegnamento in Italiano), Università degli studi di Bergamo. Docente responsabile del corso.

2010-2011 "Misurazione del rischio di credito e rischio operativo", Laurea Magistrale in Management, Finanza e International Business. Classe LM-77 (9 crediti- Insegnamento in Italiano), Università degli studi di Bergamo . Docente responsabile del corso.

2010-2011: "Teoria di portafoglio", Laurea Magistrale in Management, Finanza e International Business Classe LM-77.,(9 crediti- Insegnamento in Italiano), Università degli studi di Bergamo (di cui 3 CFU a Contratto 0000497/XIII/031 11/01/2011). Docente responsabile del corso.

2008-2009: " Misurazione e controllo del rischio di credito e dei rischio operativi", Laurea specialistica in Finanza e Mercati Classe 19/S (8 crediti- crediti- Insegnamento in Italiano), Università degli studi di Bergamo (di cui 16 ore a contratto 14563/XIII/031 09/07/2008). Docente responsabile del corso.

2004-05,2005-06,2006-07: Modelli Matematici per i mercati finanziari”, Laurea specialistica in Management, Finanza e International Business Classe LM-77 (9 crediti- Insegnamento in Italiano), Università degli studi di Bergamo . (Contratto 13576/XIII/31 28/07/2004). Docente responsabile del corso.

MASTER

2018-19: "Analisi dei dati statistici – finanziari” in master Digital Business Development” (8 ore - Insegnamento in Inglese) Università degli studi di Bergamo.

2016-2017: “Credit derivatives” in the Master Program “Prodotti strutturati” (8 ore - Insegnamento in Inglese), University Bocconi (Italy).

2014-15,2015-16: "Data Analysis & Statistics for Managers" (3 credits- crediti- Insegnamento in Inglese) EBS, Universität für Wirtschaft und Recht Oestrich-Winkel (Germany). Docente responsabile del corso. (3 edizioni)

2013-14,2014-15: " Financial modeling introduction and applications " (18 ore- Insegnamento in Inglese) EBS, Universität für Wirtschaft und Recht Oestrich-Winkel (Germany). Docente responsabile del corso.

2007-2008 "Portfolio Management" modulo nel Master's degree in Quantitative Finance (18 ore- Insegnamento in Italiano), Università di Macerata and Camerino. Docente responsabile del corso.

2007-2008: “Mathematical finance” nel Master di Microfinance in collaboration with CIPSI (Coordinamento di Iniziative Popolari di Solidarietà Internazionale) and with co-funding from the Ministry Of Foreign Affairs (MFA) (18 ore- Insegnamento in Inglese) Università degli studi di Bergamo. Docente responsabile del corso.

2006-2007 "Teoria degli investimenti I" nel Master Program "Valutazione del rischio finanziario" (40 ore- Insegnamento in Inglese) Università degli studi di Bergamo. Docente responsabile del corso.

2005-2006: "Teoria degli investimenti I" nel Master Program "Valutazione del rischio finanziario", (33 ore- Insegnamento in Inglese) Università degli studi di Bergamo. Docente responsabile del corso.

2004-2005:" Rischio, rendimento e valutazione dei titoli "(5 ore- Insegnamento in Italiano) nel Master “Corporate Finance for Managers”, Luiss University Roma.

2004-2005:" Strumenti derivati e gestione del rischio”, (5 ore- Insegnamento in Italiano) nel Master “Corporate Finance for Managers” Luiss University Roma.

DOTTORATO

2019-20: "**Financial modeling**", PhD in Applied Economics and Management (AEM) (15 ore dal 02/12 al 30/05 insegnamento in inglese), Università degli studi di Bergamo (prot.n.166287/VII/4 del16/10/2019). Docente responsabile del corso.

2018-19: "**Financial modeling**", PhD in Applied Economics and Management (AEM) (21 ore dal 02/12 al 30/05 insegnamento in inglese), Università degli studi di Bergamo. (Contratto 121521/VII/4 06/11/2017). Docente responsabile del corso.

2017-18: "**Financial modeling**", PhD in Applied Economics and Management (AEM) (9 ore dal 02/12 al 30/05 insegnamento in inglese), Università degli studi di Bergamo. (Contratto 121521/VII/4 06/11/2017). Docente responsabile del corso.

2015-16,2016-17 "Risk measurement and management" PhD in Analytics for Economics and Business (AEB) (24 ore insegnamento in inglese), Università degli studi di Bergamo.
. Docente responsabile del corso.

2011-12: "Fixed income securities and credit risk" PhD in Money and Finance, (18h insegnamento in inglese) Tor Vergata. Docente responsabile del corso.

SCUOLA INTERUNIVERSITARIA LOMBARDA DI SPECIALIZZAZIONE PER L'INSEGNAMENTO SECONDARIO

Dal 2000 al 2007 (2000-01,2001-02,2002-03,2003-04,2004-05,2005-06,2006-07): "Elementi di matematica finanziaria e attuariale -laboratorio " (10 ore) Università degli studi di Bergamo. Docente responsabile del corso.

Dal 2000 al 2007 (2000-01,2001-02,2002-03,2003-04,2004-05,2005-06,2006-07): " Fondamenti e didattica di matematica finanziaria e attuariale II", (20 ore) Università degli studi di Bergamo. Docente responsabile del corso.

ATTIVITA' DI FORMAZIONE DI TERZA MISSIONE

2017-2018: "Finanza Quantitativa"(16 ore) nell'ambito del Corso di Alta Formazione in "Economia e Finanza d'impresa "della scuola di alta formazione della Lombardia, S.A.F. Lombardia (3 repliche).

2012 Collaborazione con la Scuola di formazione della **Presidenza del Consiglio dei Ministri**. Seminario "Il mercato dei derivati creditizi" nell'ambito del corso di "Intelligence e geoeconomia" (2012).

2004-2005 Collaborazione con Carifirenze per l'insegnamento di "Misure di rischio e rendimento. Portafogli efficienti. Misure di rischio dei titoli azionari" e "Misure di rischio dei titoli obbligazionari., Modelli VaR per la misura del rischio di un portafoglio gestito", "Modelli per l'asset allocation strategica" e "Dalle misure di rischio tradizionali al VaR" (2004-2005).

2002-2003 Collaborazione con Abi Formazione per l'insegnamento di "Analisi dei portafogli di attività e modelli di asset pricing" e "Derivati sul rischio di credito" (2002-2003).

2002-2003 Corso promotori finanziari per Banca Popolare di Bergamo "Teoria del portafoglio: implicazioni operative", (2002-2003).

2001-2002 Collaborazione con Unicredit per l'insegnamento di "Analisi dei portafogli di attività e modelli di asset pricing" e "Misurare, governare, spiegare il rischio di mercato" (2001-2002).

1096-1997 Collaborazione con il Credito Bergamasco per il corso di "Matematica finanziaria e matematica dei titoli a reddito fisso", (1996-1999).

TUTORATO STUDENTI, TESI E COMMISSIONI DI DOTTORATO

Nell'ambito del dottorato di "Metodi computazionali per le previsioni e decisioni economiche e finanziarie", Università degli studi di Bergamo ha supervisionato le seguenti tesi

- Taschini L.: (XIX ciclo), 'Quantitative environmental economics: modeling marketable permits in discrete and continuous time'. (tutor)

- Sessa V. (XXI ciclo), 'Pricing credit derivatives: beyond the market standard model'. (tutor)
- Bianchi M.L.(XXI ciclo), 'Tempered stable models in finance: theory and applications'. (tutor)
- Russo V. (XXVI ciclo), 'Pricing and managing life insurance risks'. (tutor)
- Teocchi M. (XVII ciclo): 'Rischio di credito e misura della dipendenza di portafoglio di crediti: teoria e applicazioni' (supervisor)
- Farina G. (XVIII ciclo), Systemic risk measures and contagion models. (supervisor)
- Gambaro S. (XIX ciclo) Risk aversion and Expected Utility (supervisor)
- Gabriele Torri (XXXI ciclo), Network Theory in Finance. Applications to Financial Contagion Analysis and Portfolio Optimization (supervisor)
- Marco Bonomelli (XXXII ciclo) in "Models and methods for portfolio selections" (supervisor)

Ha inoltre supervisionato oltre 60 tesi di ricerca (Tipo A) Magistrali/Specialistiche e numerose tesi triennali e vecchio ordinamento.

E inoltre stata membro delle seguenti commissioni esaminatrici finali di dottorato

1. -Money and Finance - University Tor Vergata;
2. -Mathematics for the Analysis of Financial Markets, University Bicocca;
3. -Applied Mathematics - Universite Paris 1 - Pantheon -Sorbonne, Paris.
4. -Dottorato in Statistica e Matematica per la Finanza - Curriculum Matematica per la Finanza XXXI ciclo avente sede amministrativa presso l'Università degli Studi di Milano – Bicocca(2018)
5. -member of the Doctoral State Commission for a state doctoral exam in VSB - Technical University of Ostrava, Faculty of Economics, VŠB, TECHNICAL UNIVERSITY OF OSTRAVA
6. Dottorato di Ricerca XXXII Ciclo In Mercati, Impresa Consumatori -Finanza, mercati e regolazione.

Inoltre dal 2002 al 2012 ho coordinato l'attività tutorato didattico di tutto il dipartimento.

SUPERVISIONE DI ASSEGNI DI RICERCA

Tutor di un assegno annuale nell'ambito del piano straordinario per la ricerca ITALY® – Azione Giovani in Ricerca anno (2015). Titolo "Costruzione dei campanelli d'allarme per il rischio di contagio"

Tutor di un assegno Triennale nell'ambito del piano straordinario per la ricerca denominato STARS – Azione Giovani in Ricerca anno (2019) Titolo "Cause ed effetti della diffusione di portafogli sempre più overlapping' sul rischio sistemico"

Tutor di una borsa di studio (Settembre- Dicembre 2020) Titolo " Pricing, Risk And Optimization In Management Science"

INCARICHI ISTITUZIONALI

INCARICHI ISTITUZIONALI PIU' RILEVANTI

Nominata il 24/3/2020 **Direttore vicario** del Dipartimento di Scienze aziendali, economiche e metodi quantitativi(fino al 1/10/2020).

1/1/2016- 31/12/2018 **Membro del Consiglio di Amministrazione** presso l'Università degli Studi di Bergamo (D.R. Rep. n. 737, prot. n. 81838/II/8 22/12/2015) dal 01/01/2016 al 31/12/2018.

2015-2016 **Direttore del Master di II Livello** "L'operatore Educativo e L'autismo" (2015-2016) per il quale ha ottenuto un finanziamento di 45,000 euro da Rotary Citta' alta Bergamo (Prot 80422/VII/4 11/12/2015).

2014-2015 **Prorettore con Delega** presso Università degli Studi di Bergamo per l'integrazione degli studenti disabili e con DSA (D.R. Rep. n. 43, prot. n. 2202/II/2 29/01/2014) dal 01/02/2014 al 30/09/2015.

2012-2015 **Presidente del consiglio della ricerca**, organo di supporto al direttore del dipartimento di Scienze Aziendali, Economiche e Metodi quantitativi (nomina in CdD SAEMQ del 25/10/2012 fino al 30/9/2015).

2005-2009 **Delegato del Rettore** presso Università degli Studi di Bergamo per la Disabilità (D.R. 25380/II/003 01/12/2005) dal 01/11/2005 al 30/09/2009.

2003-2005 **Delegato del Rettore** presso Università degli Studi di Bergamo per la Disabilità(D.R. 1822/II/002 04/02/2004) dal 01/11/2003 al 31/10/2005.

2002-2003 **Delegato del Rettore** presso Università degli Studi di Bergamo per la Disabilità. Presidente (D.R. 18924/II/002 20/12/2002). Dal 20/12/2002 al 31/10/2003.

2003-2009 **Coordinatrice** dell'Indirizzo Fisico-Informatico-Matematico della Scuola Interuniversitaria Lombarda di Specializzazione per l'Insegnamento Secondario Sezione di Bergamo e Brescia dal 14/11/2003 (verbale n.° 7/2003 del Consiglio della Sezione di Bergamo e Brescia S.I.L.S.I.S.) fino al 25/9/2009.

ALTRI INCARICHI DI SERVIZIO E ORGANIZZATIVI

2018- a oggi Responsabile accordi Erasmus Plus con Charles University, Praga.

2017- a oggi Responsabile dell'accordo con Texas Tech University (2017).

Dal 2017 nominata dal Rettore referente per il dipartimento di Scienze Aziendali, Economiche e Metodi quantitativi del progetto Dual Carrier prot 51129/II/2 14/6/2017.

Dal 2017 membro del consiglio di dottorato "Economia e gestione applicata" (AEM) presso l'Università di Bergamo.

Dal 2016 al 2018 membro della commissione per le Attività Culturali e Sociali degli studenti come membro del consiglio di amministrazione (Decreto 24515/IV/016).

Dal 2016 a oggi rappresentante dell'Università di Bergamo nel Consiglio direttivo del CUS (prot 28295/I/14 25/2/2016).

Dal 2015 al 2018 membro del consiglio della Didattica (vd SAEMQ 04.11.15)

Dal 2014 al 2018 responsabile dell'accordo con EBS Universität für Wirtschaft und Recht, EBS Business School for the PhD program.

2012 Responsabile TFA A048 -Matematica Applicata dal 17/5/2012 all'11/12/12.

Dal 2009 al 2013 Coordinatore del progetto di collaborazione didattica con l'Università Lumière Lyon 2 (Francia) dal 01/10/2009 al 30/09/2013.

Dal 2009 al 2014 Delegato del Rettore e Presidente della commissione per le attività culturali e sociali degli studenti (Decreto prot. n. 24515/IV/016) dal 17/11/2009 al 30/9/2014.

Dal 2002 al 2012 Responsabile progetto attività tutorato didattico dal 01/10/2002 al 30/09/2012.

Dal 2009 al 2012 Componente della Commissione Rapporti Internazionali di Facoltà come rappresentante dell'area statistico-matematica-informatica e tutor degli studenti stranieri in ingresso dal 01/10/2009 al 30/09/2012.

Dal 2007 al 2009 Membro della Commissione della Facoltà di Economia per la Definizione Criteri Posti di Ruolo (COMCRI) (12/12/2007 al 30/9/2009).

Dal 1996 al 2010 Membro della Commissione Didattica in qualità di rappresentante dell'area matematica (dal 1996 al 2010).

Dal 2001 al 2002 Membro commissione per i servizi ai disabili (24/5/2001 – 20/12/2002).

Dal 2003 al 2010 Componente della Giunta della Sezione dal Consiglio della Sezione di Bergamo e Brescia della S.I.L.S.I.S. .

Dal 2003 al 2010 Membro del comitato di gestione del “Osservatorio Fusioni e aggregazioni tra intermediari finanziari” FinMonitor (dal 2003 al 30/6/2010).

MEMBRO DI COMMISSIONE NELL'AMBITO DI PROCEDURE DI SELEZIONE COMPETITIVE NAZIONALI E INTERNAZIONALI.

Università degli Studi di BRESCIA Commissario del Concorso ad un posto da Ricercatore universitario presso la Facoltà di ECONOMIA , settore disciplinare S04A: MATEMATICA PER LE APPLICAZIONI ECONOMICHE. Il bando è stato pubblicato sul supplemento alla Gazzetta n. 30 del 14/04/2000 Nomina della commissione con decreto n. 1119 del 07/08/2000 , pubblicato sulla G.U. 67 (suppl.) del 29/08/2000

Università degli Studi di MACERATA. Commissario del Concorso ad un posto da Ricercatore universitario presso la Facoltà di ECONOMIA, settore disciplinare SECS-S/06: METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E DELLE SCIENZE ATTUARIALI E FINANZIARIE Il bando è stato pubblicato sulla Gazzetta n. 60 del 08/08/2006 Nomina della commissione con decreto n. 389 del 29/03/2007 , pubblicato sulla G.U. 30 del 13/04/2007

RICERCA

PROGETTI DI RICERCA COMPETITIVI

Oltre ai fondi di ateneo ex60% che sono distribuiti in base alla produttività individuale, nella cui graduatoria occupa la top list dei finanziati, si riportano i progetti competitivi

GACR 2018-2021

PRINCIPAL INVESTIGATOR del progetto finanziato dalla fondazione scientifica della Repubblica Ceca (GACR) dal 2018- 2021 . Titolo del progetto: “A network approach to portfolio optimization and tracking problems”. Numero identificativo del progetto di ricerca: 19-11965S

MIUR(PRIN) 40% 2010	MIUR (PRIN) 40% in 2010 "Multivariate Statistical Models for the evaluation of risks" in collaboration with Pavia (national coordinator and unity coordinator Paolo Giudici of Pavia).
MIUR(PRIN) 40% 2007	"Financial innovation and demographic changes: new products and assessment tools in the face of the element stochastic aging" (Torricelli National Coordinator);
MIUR(PRIN) 40% 2006	MIUR (PRIN) 40% 2006 Sensitivity analysis in problems of management of portfolios of securities "(local coordinator Bertocchi)
Contributo CNR 5% legge 95/95	"Neural networks for credit risk assessment and the management of credit portfolios" (Bertocchi National Coordinator);
-Contributo CNR 96.01313.CT10 e CNR 97.01205.CT10	"Analysis and development of methodologies for financial market applications: computational aspects" (Bertocchi coordinator)
MIUR(PRIN) 40% 2002	"Methods and techniques for portfolio optimization and for the evaluation of financial instruments" (local coordinator Bertocchi);
MIUR(PRIN) 40% 2005	"Measuring and controlling credit risk for default risk exposed securities portfolios" (Torricelli National Coordinator);
MURST 40% 96	"Analisi della sensitività in problemi di gestione di portafogli di titoli"

PROGETTI DI RICERCA CON AZIENDE

Volvo (20/12/2013 – 30/09/2014)	"Analysis and Assessment of Financial Management of the Service packages", Coordinator: Giacometti, Funding of € 12,000.00.
Volvo (11/12/2012 – 31/05/2013)	"Service packages & headlights price", Coordinator: Giacometti Funding of € 14,000.00.
ENEL Energia- 2012 (Competitivo)	"The determinants of the demand for electricity in Italy", Coordinator Prof Urga ,Funding of € 30,000.00.
UBI Bank 2006-2007	"Portfolio analysis of operational risks", Coordinators: Rachev – Bertocchi, Funding of € 62,400.00.
ICE srl 2005-2006	'Optimization of the edge of a natural gas sales company' Coordinator: Bertocchi, Funding of € 40,000.00.
Regione Lombardia 2011-2012	'Methods for integration of renewable energy sources and environmental impact monitoring satellite', EN-17, ID 17369.10, (2011- 2012) (Coordinator Bertocchi and Vespucci)

PARTECIPAZIONE A GRUPPI DI RICERCA E MEMBERSHIP E' iscritta alla associazione AMASES (Associazione per la Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali) dal 1996 e dal 2018 a AIFIRM (Associazione Italiana Financial Industry Risk Managers).

Gruppi di ricerca:

-2018-2021 Repubblica ceca. Technical university of Ostrava, Faculty of economics department of Finance. Ricerca : "A network approach to portfolio optimization and tracking problems".

-2010-2013 Partecipazione al gruppo di ricerca di Pavia(membro dell'unita' locale prin
"Multivariate Statistical Models for the evaluation of risks" coordinato da Paolo Giudici of Pavia.

ORGANIZZAZIONE CONVEGNI

2019 Membro del comitato scientifico della JOINT CONFERENCE. EURO WORKING GROUP FOR
COMMODITIES AND FINANCIAL MODELLING 64th MEETING & XVIII INTERNATIONAL
CONFERENCE ON FINANCE AND BANKING FI BA 2020, March 26-28, 2020, Bucharest
30-31 Maggio, 1 Giugno 2017, membro del comitato scientifico e organizzatore della conferenza
"Computational Management Science Pricing, Risk and Optimization" in Management Science,
Bergamo,
4/ 12/2017 Bergamo Comitato scientifico del Convegno organizzato in onore di Altman Z-SCORE:
"A 50 anni dalla prima formulazione, il più diffuso modello di previsione dell'insolvenza presenta
ancora nuove applicazioni." 10th ELAB SYMPOSIUM

ORGANIZZAZIONE DI SESSIONI A CONVEGNI

2019 CFE London 14-16 December Chair of the session "Contributions in portfolio optimization II"

2020 Computational Management Science, Venezia Luglio 2020 (sospeso per COVID)

ATTIVITA' DI REFERAGGIO

Svolge regolare attività di referaggio per molte riviste, tra le quali

Journal of Economic Dynamics and Control ; The Economic Journal; Journal of Banking and Finance;
Journal of Operational Risk; Annals of Operations Research; European journal of Operational
Research; Empirical Finance, 4OR, A Quarterly Journal of Operations Research; Risk; Mathematical
review; Insurance and mathematics; Quantitative finance

ATTIVITA' EDITORIALE

2017-2019 Guess editor per la rivista Computational Management Science dello special Issue
"Computational Management Science: S.I. of the Conference in Bergamo".

PARTECIPAZIONE A CONVEGNI

2019 CFE London 14-16 December Chair of the session "Contributions in portfolio optimization II"
2019 AMASES 9-11 Settembre, Perugia
2019 Euro XXIII - 26 Giugno 2019, in UCD, Dublino
2018: AMASES, Napoli 14-15 Settembre 2018.
2017: Computational Management Science 2017, Bergamo 30 May-1 June 2017 .
2017: Heavy tails and Long range dependence Paris June 20-22, 2017.
2017: 41th Annual Meeting of the. Italian Association for Mathematics Applied to Economic and
Social Sciences (AMASES). Cagliari, September 2107.
2016: 40th Annual Meeting of the. Italian Association for Mathematics Applied to Economic and
Social Sciences (AMASES). Catania, September 10-12, 2106.
2016: The 10th International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE) Sevilla,
SP, December 2016.
2015: 39th Annual Meeting of the. Italian Association for Mathematics Applied to Economic and
Social Sciences (AMASES). Padova, September 10-12, 2105.
2015: The 9th International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE)
London, UK, 12-14 December 2015.
2015: 27th Annual Conference EURO- 12 July to 15 July 2015 - University of Strathclyde, Glasgow.

2014: 8th International Conference on Computational and Financial Econometrics, 6-8 December - 2014, University of Pisa, Italy.

2013: XIV Iberian-Italian Congress of Financial and Actuarial Mathematics, Madrid, Spain June 24, 25 and 26, 2013.

2012: "XXXVI Convegno A.M.A.S.E.S.", Vieste, 13-15 Settembre 2012.

2011: "XXXV Convegno A.M.A.S.E.S.", Pisa, Italia, 15-17 Settembre 2011.

2011: "XLII Convegno AIRO", Brescia, 6-9 Settembre 2011.

2010: XI Workshop on Quantitative Finance", Palermo, 28-29 Gennaio 2010.

2010: International Summer School on "Risk Measurement and Control, Roma, 8-9 Giugno 2010.

2010: "XXXIV Convegno AMASES, Macerata, 1-4 Settembre 2010.

2010: XXIV Convegno EURO", Lisbon, Portogallo, 11-14 Luglio 2010.

2010: "The 2010 International Conference on Management and Service Science (MASS 2010)", Wuhan, Cina, 24-26 August 2010.

'XXIII Convegno EURO" Bonn Germany 5-8 Luglio, 2009.

2009: "III International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE'09)", Limassol, Cyprus, 29-31 October 2009.

2008: XLIII Euro Working Group on Financial Modelling", Cass Business School London, UK, 4-6 Settembre 2008.

2007: "XL Euro Working Group on Financial Modelling", Rotterdam, 10-12 Maggio 2007.

2007: "XXII Convegno EURO" Prague, Czech Republic, 8-11 Luglio 2007.

2007: "XXXVIII Convegno AIRO", Genova, 5-8 Settembre 2007.

2007: "VIII Workshop on Quantitative Finance", Ca' Foscari Venezia, 25-26 Gennaio 2007;

2007: International Summer School in "Risk Measurement and Control" Roma, 11-16 Giugno 2007;

2006: International Summer School "Risk Measurement and Control" Roma, 6-18 June 2006;

2006: "XXXVII Euro Working Group on Financial Modelling, Jakarta, May 1-6, 2006.

2004: "XXXIV Euro Working Group on Financial Modelling", Parigi, 12-14 maggio 2004.

2003: XXVII Convegno A.M.A.S.E.S.", Cagliari, 3-6 Settembre 2003.

2003: "Convegno dell'IFORS", Istanbul, 6-10 Luglio 2003.

2002: "XXX Euro Working Group on Financial Modelling", Capri, 2-5 maggio 2002.

2002: "XXIX Euro Working Group in Financial Modelling", Edinburgh, UK, 8-12 luglio 2002;

2002: APMOD 2002, Varenna, 16-19 Giugno 2002.

2001: "XV Convegno AIRO", Villasimius (Cagliari), 4-7 settembre 2001.

2000: "XXVII Euro Working Group in Financial Modelling", 27th Meeting", New York, 16-18 Novembre 2000.

2000: "XXIV Convegno A.M.A.S.E.S.", Padenghe sul Garda, 6-9 Settembre 2000.

2000: "XIV Convegno AIRO", Milano Bicocca 18-21 Settembre 2000.

1999: "XXIV Euro Working Group in Financial Modelling" Valencia, 8-10 Aprile 1999.

1999: "Computing in Economics and Finance" Boston College, Boston, 24-26 Giugno 1999;

1997: "XXI Convegno A.M.A.S.E.S.", Roma, 10-13 Settembre 1997.

1997: International Conference on transition to advanced market institutions and economies", Warsaw, 18-21, giu-1997; 1996: "XX Convegno A.M.A.S.E.S., Urbino, 5-7 Settembre 1996.

1996: "XVIII Euro Working Group in Financial Modelling", Keele, England, 18-20 April 1996.

1995: "XVII Euro working group on financial modelling", Bergamo, 1-3 giugno 1995.

1995: "XIX Convegno A.M.A.S.E.S.", Pugnuchiuso, 25-28, Settembre 1995.

1993: "4th International Workshop On Parallel Applications in Statistics and Economics", Ascona, Switzerland, 22-26 Novembre 1993.

SEMINARI SU INVITO

- 2016: Prometeia, Bologna, "CDS data: factor decomposition and risk attribution in the European Union".
- 2013: EBS University, Wiesbaden, "Estimating the probability of a multiple default using CDS and bond data".
- 2012: Facoltà di Economia di Pavia, "An assessment for credit risk and operational risk".
- 2012: SUNY Stony Brook University, NY, USA, "The Credit default swap market and its implied information", NY, USA.
- 2012: University of Minnesota, Financial Mathematics Seminar, "The Credit default swap market and its implied information", Minneapolis, USA.
- 2012: IX International Summer School on "Risk Measurement and Control", "Time Series and Copula Dependency Analysis for Eurozone Sovereign Bond Returns" (Svetlozar Rachev e Naoshi Tsuchida, Stony Brook University), Roma.
- 2011: KIT Karlsruher Institut für Technologie Institut für Wirtschaftstheorie und Statistik "Using Black & Litterman framework for stress testing analysis in asset management", Karlsruhe; Germany.
- 2011: Summer School in Finance, Università di Bergamo e Politecnico Milano, Settembre 2011 "Gli scenari della finanza oggi".
- 2010: Faculty of Economic di Foggia, "A stochastic model for hedging electricity portfolio for an hydro-energy producer", Foggia.
- 2010: Doctorate School EPS "Economics Panthéon-Sorbonne" of University Paris1 panthéon-Sorbonne, "A stochastic model for hedging electricity portfolio for an hydro-energy producer", Parigi.
- 2010: KIT Karlsruher Institut für Technologie Institut für Wirtschaftstheorie und Statistik, "A stochastic model for hedging electricity portfolio for an hydro-energy producer", Karlsruhe, Germany.
- 2009: Risk Events, "Portfolio Construction: Robust Optimisation & Risk Budgeting Modelling risk and return in the real world", London.
- 2009: University of Cyprus, Department of Public and Business Administration "Rischi operativi" e "Modelli stocastici per la costruzione di portafogli elettrici con contratti di copertura", Nicosia, Cipro.
- 2008: OpRisk Europe 2008, "Heavy tail distribution models for operational losses", Londra.
- 2008: Doctorate School EPS "Economics Panthéon-Sorbonne" of University Paris1 panthéon-Sorbonne, "Heavy tail distribution models for operational losses", Paris.

PUBBLICAZIONI

PAPER RELATIVI A RICERCHE IN CORSO

1. Rujirarangsarn, Giacometti, Cameletti The Spatial Multivariate GARCH Model on Credit Risk Application
2. Farina, Giacometti Deriving portfolio loss distribution under infectious defaults with immunization per Journal of the Operational Research Society
3. Russo, Giacometti : Measuring the resilience of the insurance companies under Solvency II

SOTTO REFERAGGIO

1. Torri G., Giacometti R., and Tichy T., Network tail risk estimation in the European banking system (prima revisione JOURNAL OF ECONOMIC DYNAMICS & CONTROL);
2. Giacometti R., Torri G. Penalized Expectiles Optimal Portfolios (sotto revisione in 4Or)

1. Giacometti, R., Torri, G., & Paterlini, S. (2021). Tail risks in large portfolio selection: penalized quantile and expectile minimum deviation models. *Quantitative Finance*, 21(2), 243-261.
2. Giacometti, R., Torri, G., Farina, G., & De Giuli, M. E. (2020). Risk attribution and interconnectedness in the EU via CDS data. *Computational Management Science*, 17(4), 549-567
3. Russo V. Giacometti R. Fabozzi F(2020), Closed-Form Solution for Defaultable Bond Options under a Two-Factor Gaussian Model for Risky Rates Modeling. DOI:10.3905/jod.2020.1.104. pp.jod.2020.1.104-27. In THE JOURNAL OF DERIVATIVES - ISSN:1074-1240
4. Bonomelli, M., Giacometti, R. & Ortobelli Lozza, S.(2020) Joint tails impact in stochastic volatility portfolio selection models. *Ann Oper Res* (2020). <https://doi.org/10.1007/s10479-020-03531-w>
5. Torri, G., Giacometti, R. and Paterlini, S. (2019) Sparse Precision Matrices for Minimum Variance Portfolios, *Computational Management Science* (2019). <https://doi.org/10.1007/s10287-019-00344-6>
6. G. Farina, R. Giacometti & M. E. De Giuli (2019) Systemic risk attribution in the EU, *Journal of the Operational Research Society*, DOI: 10.1080/01605682.2018.1487823
7. Torri, Gabriele and Giacometti, Rosella and Paterlini, Sandra (2018), Robust and Sparse Banking Network Estimation. *European Journal of Operational Research*. Online from April 2018 <https://doi.org/10.1016/j.ejor.2018.03.041>
8. Russo, Giacometti, Fabozzi (2018) Market Implied Volatilities for Defaultable Bonds, *Annals of Operations Research* DOI: 10.1007/s10479-018-3064-z
9. Russo Vincenzo, Giacometti Rosella, Fabozzi Frank J. (2017). Intensity-based framework for surrender modeling in life insurance. *INSURANCE: MATHEMATICS & ECONOMICS*, vol. 72, p. 189-196, ISSN: 0167-6687, doi: 10.1016/j.insmatheco.2016.11.001
10. Fabozzi Frank J., Giacometti Rosella, Tsuchida Naoshi (2016). Factor decomposition of the Eurozone sovereign CDS spreads. *JOURNAL OF INTERNATIONAL MONEY AND FINANCE*, vol. 65, p. 1-23, ISSN: 0261-5606, doi: 10.1016/j.jimonfin.2016.03.003
11. Vincenzo Russo, Rosella Giacometti, Svetlozar T. Rachev, Frank J. Fabozzi (2015). A Three-Factor model for mortality modeling. *NORTH AMERICAN ACTUARIAL JOURNAL*, vol. 19, p. 129-141, ISSN: 1092-0277, doi: 10.1080/10920277.2015.1015262
12. Pianeti Riccardo, Giacometti Rosella (2015). Estimating the probability of multiple EU sovereign defaults using CDS and bond data. *QUANTITATIVE FINANCE*, vol. 15, p. 61-78, ISSN: 1469-7688, doi: 10.1080/14697688.2014.932919
13. Giacometti Rosella, Ortobelli Lozza Sergio, Tichý Tomáš (2015). Portfolio selection with uncertainty measures consistent with additive shifts. *PRAGUE ECONOMIC PAPERS*, vol. 24, p. 3-16, ISSN: 1210-0455, doi: 10.18267/j.pap.497
14. ZHOU XIAOPING, GIACOMETTI ROSELLA, FABOZZI FRANK J., TUCKER ANN H. (2014). Bayesian estimation of truncated data with applications to operational risk measurement. *QUANTITATIVE FINANCE*, vol. 14, p. 863-888, ISSN: 1469-7688, doi: 10.1080/14697688.2012.752103
15. TSUCHIDA NAOSHI, GIACOMETTI ROSELLA, FABOZZI FRANK J., SHIN KIM YOUNG, FREY ROBERT J. (2014). Time series and copula dependency analysis for Eurozone sovereign bond returns. *THE JOURNAL OF FIXED INCOME*, vol. 24, p. 75-87, ISSN: 1059-8596, doi: 10.3905/jfi.2014.24.1.075
16. Giacometti Rosella, Vespucci Maria Teresa, Bertocchi Maria, Barone-Adesi Giovanni (2013). Deterministic and stochastic models for hedging electricity portfolio of a hydropower producer. *STATISTICA & APPLICAZIONI*, p. 57-77, ISSN: 1824-6672
17. BERTOCCHI MARIA, GIACOMETTI ROSELLA, RECCHIONI MARIA CRISTINA, ZIRILLI FRANCESCO (2013). Pricing life insurance contracts as financial options: the endowment policy case. *FAR EAST JOURNAL OF MATHEMATICAL SCIENCES: FJMS*, p. 69-121, ISSN: 0972-0871
18. GURNÝ MARTIN, ORTOBELLI LOZZA SERGIO, GIACOMETTI ROSELLA (2013). Structural credit risk models with subordinated processes. *JOURNAL OF APPLIED MATHEMATICS*, p. 217-226, ISSN: 1110-757X, doi: 10.1155/2013/138272
19. GIACOMETTI ROSELLA, BERTOCCHI MARIA, RACHEV SVETLOZAR T., FABOZZI FRANK J. (2012). A comparison of the Lee-Carter model and AR-ARCH model for forecasting mortality rates. *INSURANCE MATHEMATICS & ECONOMICS*, vol. 50, p. 85-93, ISSN: 0167-6687, doi: 10.1016/j.insmatheco.2011.10.002

20. CASTELLANO ROSELLA, GIACOMETTI ROSELLA (2012). Credit default swaps: implied ratings versus official ones. *4OR*, vol. 10, p. 163-180, ISSN: 1619-4500, doi: 10.1007/s10288-011-0195-3
 21. PIANETI, Riccardo, GIACOMETTI, Rosella, ACERBIS, Valentina (2012). Estimating the joint probability of default using Credit Default Swap and Bond Data. *THE JOURNAL OF FIXED INCOME*, vol. 21, p. 44-58, ISSN: 1059-8596, doi: 10.3905/jfi.2012.21.3.044
 22. KIM YOUNG SHIN, GIACOMETTI ROSELLA, RACHEV SVETLOZAR T., FABOZZI FRANK J., MIGNACCA DOMENICO (2012). Measuring financial risk and portfolio optimization with a non-Gaussian multivariate model. *ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH*, vol. 201, p. 325-343, ISSN: 0254-5330, doi: 10.1007/s10479-012-1229-8
 23. GIACOMETTI ROSELLA, ORTOBELLI LOZZA SERGIO, BERTOCCHI MARIA (2011). A stochastic model for mortality rate on Italian data. *JOURNAL OF OPTIMIZATION THEORY AND APPLICATIONS*, vol. 149, p. 216-228, ISSN: 0022-3239, doi: 10.1007/s10957-010-9771-5
 24. Russo Vincenzo, Giacometti Rosella, Ortobelli Lozza Sergio, Rachev Svetlozar T., Fabozzi Frank J. (2011). Calibrating affine stochastic mortality models using term assurance premiums. *INSURANCE MATHEMATICS & ECONOMICS*, vol. 49, p. 53-60, ISSN: 0167-6687, doi: 10.1016/j.insmatheco.2011.01.015
 25. MAGGIONI, Francesca, BERTOCCHI, Maria, GIACOMETTI, Rosella, VESPUCCI, Maria Teresa, INNORTA, Mario, ALLEVI, Elisabetta (2010). A stochastic optimization model for gas retail with temperature scenarios and oil prices parameters. *IMA JOURNAL OF MANAGEMENT MATHEMATICS*, vol. 21, p. 149-163, ISSN: 1471-678X, doi: 10.1093/imaman/dpp011
 26. Giacometti Rosella, Mignacca Domenico (2010). Using Black and Litterman framework for stress testing analysis in asset management. *JOURNAL OF ASSET MANAGEMENT*, vol. 11, p. 286-297, ISSN: 1470-8272, doi: 10.1057/jam.2009.33
 27. Giacometti Rosella, Bertocchi Maria, Ortobelli Lozza Sergio (2009). Impact of different distributional assumptions in forecasting Italian mortality rates. *INVESTMENT MANAGEMENT & FINANCIAL INNOVATIONS*, vol. 6, p. 65-72, ISSN: 1810-4967
 28. Giacometti Rosella, Rachev Svetlozar Todorov, Chernobai Anna, Bertocchi Maria (2008). Aggregation issues in operational risk. *THE JOURNAL OF OPERATIONAL RISK*, vol. 3, p. 3-23, ISSN: 1744-6740
 29. Giacometti Rosella, Rachev T. Svetlozar (2008). Funds of Hedge Funds: a Comparison among Different Portfolio Optimization Models implementing the Zero-Investment Strategy. *INVESTMENT MANAGEMENT & FINANCIAL INNOVATIONS*, vol. 5, p. 19-29, ISSN: 1810-4967
 30. Giacometti Rosella, Rachev Svetlozar Todorov, Chernobai Anna, Bertocchi Maria, Consigli Giorgio (2007). Heavy-tailed distributional model for operational losses. *THE JOURNAL OF OPERATIONAL RISK*, vol. 2, p. 55-90, ISSN: 1744-6740
 31. Giacometti Rosella, Bertocchi Maria, Rachev Svetlozar Todorov, Fabozzi Frank (2007). Stable distributions in the Black-Litterman approach to asset allocation. *QUANTITATIVE FINANCE*, vol. 7, p. 423-433, ISSN: 1469-7688, doi: 10.1080/14697680701442731
 32. Giacometti Rosella, Teocchi Mariangela (2005). On pricing of Credit spread options. *EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONAL RESEARCH*, vol. 163, p. 52-64, ISSN: 0377-2217, doi: 10.1016/j.ejor.2003.12.005
 33. Bertocchi Maria, Giacometti Rosella, Zenios Stavros A. (2005). Risk factor analysis and portfolio immunization in the corporate bond market. *EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONAL RESEARCH*, vol. 161, p. 348-363, ISSN: 0377-2217
 34. Abaffy, Jozsef, BERTOCCHI, Maria, Dupacova, Jitka, GIACOMETTI, Rosella, Huskova, Marie, Moriggia, Vittorio (2003). A nonparametric model for analysis of the EURO bond market. *JOURNAL OF ECONOMIC DYNAMICS & CONTROL*, vol. 27, p. 1113-1131, ISSN: 0165-1889, doi: 10.1016/S0165-1889(02)00057-X
 35. Giacometti Rosella, Castellano Rosella (2001). Performance of a Hedged portfolio Model in presence of Extreme events. *COMPUTATIONAL ECONOMICS*, vol. 17, p. 239-252, ISSN: 0927-7099, doi: 10.1023/A:1011632311173
 36. Bertocchi Maria, Giacometti Rosella, Slominski Leon (2000). Bond portfolio management with repo contracts: the Italian case. *ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH*, vol. 97, p. 111-129, ISSN: 0254-5330
 37. Giacometti Rosella, Bertocchi Marida (1993). Global Continuous Optimization: a Parallel Genetic Approach. *NEURAL NETWORK WORLD*, vol. 6, p. 665-680, ISSN: 1210-0552
 38. Rosella Giacometti (1993). On Optimal Design of Treasury Bonds. *COMPUTATIONAL*
-

**ARTICOLI IN
PROCEEDING**

39. G. Torri, T. Tichy, R. Giacometti, (2018), Network conditional tail risk estimation in the European Banking System. Managing and Modelling of Financial Risks – 9th International Scientific Conference. Proceedings. ISBN 978-80-248-4225-7. Ostrava, Czech Republic, 550 – 557.
40. Torri, Gabriele, Giacometti, Rosella, Rachev, Svetlozar (2017). Option Pricing in Non-Gaussian Ornstein-Uhlenbeck Markets. In: Financial Management of Firms and Financial Institutions. p. 1-10, ISBN: 978-80-248-4138-0, Ostrava, Czech Republic, 6th - 7th September 2017
41. GURNÝ MARTIN, ORTOBELLI LOZZA SERGIO, GIACOMETTI ROSELLA (2013). A comparison of estimated default probabilities: Merton model vs. stable Paretian model. In: Proceedings of the 9th International Scientific Conference Financial Management of Firms and Financial Institutions. p. 217-226, ISBN: 978-80-248-3172-5, Ostrava, Czech Republic, 9-10/9/2013
42. Giacometti Rosella, Vespucci Maria Teresa, Bertocchi Maria (2010). A multi-stage stochastic electricity portfolio model with forward contracts. In: 2010 International Conference on Management and Service Science (MASS 2010). p. 1-4, IEEE (Institute of Electrical and Electronics Engineers), ISBN: 978-142445326-9, Wuhan, Cina, 24-26 August 2010, doi: 10.1109/ICMSS.2010.5577154
43. Bertocchi M, Giacometti R (1992). The parallel genetic algorithm as global optimizer. In: The proceeding of working Day held in Verona. p. 29-42, Verona:Universita' di Verona
44. Torri, Gabriele, Paterlini, Sandra, Giacometti, Rosella (2017). Sparse Precision matrices for minimum variance portfolios. In: 10th International Conference of the ERCIM WG on Computational and Methodological Statistics (CMStatistics 2017). p. 160, ECOSTA ECONOMETRICS AND STATISTICS, ISBN: 978-9963-2227-4-2, London, UK, 16-18 December 2017
45. Torri, Gabriele, Giacometti, Rosella, Paterlini, Sandra (2016). Capturing systemic risk by robust and sparse network estimation. In: 10th International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE 2016). Book of Abstracts. p. 84, ISBN: 978-9963-2227-1-1, Seville, Spain, 9 – 11 December 2016

LIBRI

46. GIACOMETTI, Rosella, EPIS, CRISTIAN (2013). Esercizi di matematica finanziaria. TORINO:Giappichelli, ISBN: 978-88-348-8876-6
47. BERTOCCHI, Maria, CONSIGLI, Giorgio, D'ECCLESIA, Rita Laura, GIACOMETTI, Rosella, MORIGGIA, Vittorio, ORTOBELLI LOZZA, Sergio (2013). Euro bonds : markets, infrastructure and trends. WORLD SCIENTIFIC SERIES IN FINANCE, vol. 7, SINGAPORE:World Scientific, ISBN: 978-981-4440-15-8, ISSN: 2010-1082
48. GIACOMETTI, Rosella, EPIS, CRISTIAN (2010). Appunti di matematica finanziaria. TORINO:Giappichelli, ISBN: 978-88-348-1414-7

CURATELE

49. Giacometti , Rosella, Rustam, Berç (a cura di) (2019). Special issue: 14th International Conference on Computational Management Science. COMPUTATIONAL MANAGEMENT SCIENCE, vol. 16, Heidelberg; Berlin:Springer, ISSN: 1619-697X, doi: 10.1007/s10287-019-00343-7

**CAPITOLI IN
LIBRO**

50. Bertocchi Maria, Giacometti Rosella, Vespucci Maria Teresa (2015). Risk measures and management in the energy sector. In: (a cura di): Zopounidis Constantin;Galarotis Emiliios, Quantitative Financial Risk Management: Theory and Practice. p. 126-151, Chichester:John Wiley & Sons, Inc., ISBN: 978-1-118-73818-4, doi: 10.1002/9781119080305.ch6
51. GIACOMETTI ROSELLA (2013). Credit derivatives markets. In: Bertocchi Marida;Consigli Giorgio;D'Ecclesia Rita;Giacometti Rosella;Moriggia Vittorio;Ortobelli Lozza Sergio. Euro bonds: Markets, Infrastructure and Trends. WORLD SCIENTIFIC SERIES IN FINANCE, vol. 7, p. 223-248, Singapore:World Scientific Publishing, ISBN: 978-981-4440-15-8, ISSN: 2010-1082, doi: 10.1142/9789814440165_0008
52. GIACOMETTI ROSELLA (2013). Securitization market. In: Bertocchi Marida;Consigli Giorgio;D'Ecclesia Rita;Giacometti Rosella;Moriggia Vittorio;Ortobelli Lozza Sergio. Euro bonds:

Markets, Infrastructure and Trends. WORLD SCIENTIFIC SERIES IN FINANCE, vol. 7, p. 149-169, SINGAPORE:World Scientific, ISBN: 978-981-4440-15-8, ISSN: 2010-1082, doi: 10.1142/9789814440165_0006

53. GIACOMETTI, Rosella, BERTOCCHI, Maria, VESPUCCI, Maria Teresa, BARONE ADESI, GIOVANNI (2011). Hedging electricity portfolio for an hydro-energy producer via stochastic programming. In: (a cura di): Bertocchi Marida;Consigli Giorgio;Dempster Michael A. H., Stochastic Optimization Methods In Finance And Energy: new financial products and strategies in liberalised energy markets. INTERNATIONAL SERIES IN OPERATIONS RESEARCH & MANAGEMENT SCIENCE, vol. 163, p. 163-180, NEW YORK:Springer, ISBN: 978-1-4419-9585-8, ISSN: 0884-8289, doi: 10.1007/978-1-4419-9586-5_8
54. GIACOMETTI ROSELLA, RACHEV SVETLOZAR TODOROV, BERTOCCHI MARIA, FABOZZI FRANK J. (2008). Stable distributions in the Black-Litterman approach to asset allocation. In: (a cura di): Dempster M.A.H.;Mitra Gautam;Pflug Georg, Quantitative Fund Management. p. 359-377, Chapman and Hall, ISBN: 9781420081916
55. ORTOBELLI LOZZA SERGIO, GIACOMETTI ROSELLA (2004). Risk measures for asset allocation models. In: (a cura di): SZEGO G., Risk Measures in the 21st century. p. 69-86, Wiley & Sons, ISBN: 978-0-470-86154-7
56. GIACOMETTI R, M. TEOCCHI (2003). La composizione di un portafoglio di attività finanziarie efficiente: richiami teorici e implicazioni operative. In: BANCARIA EDITRICE. Gestione del risparmio e della clientela nel private banking. p. 105-147, ISBN88-449-0308-3 MILANO:Edibank-Bancaria Editrice
57. GIACOMETTI R, Castellano R.(2000). Improving Portfolio Performances Using Option Strategies. In: MARIA BONILLA, TRINIDAD CASASUS, RAMON SALA EDITORS. Financial Modelling (Contributions to Management Science). p. 125-141, berlin:Physica-Verlag HD; 1 edition (June 10, 2002) <https://doi.org/10.1111/1468-036X.00145>
58. GIACOMETTI R, C. NUZZO (1994). Embedded option pricing on interest rate sensitive securities in the Italian market. In: R.L. D'ECCLESIA E S. ZENIOS EDS,. Operations Research Models in Quantitative Finance. p. 210-234, DOI<https://doi.org/10.1007/978-3-642-46957-2> Heidelberg:Physica-Verlag, ISBN: 3790808032

TECNICAL REPORTS

59. Farina, Gianluca; Giacometti, Rosella (2016) , Portfolio loss modeling: an infectious framework” Working papers MEQ. Quantitative Methods Series No. 1, - University of Bergamo, 2016;
 60. Gambarini, S.; Giacometti, Rosella; Zigrino, Stefano(2012) ,Scenario generation for long term fuel prices, Working paper del Dipartimento di Scienze aziendali, economiche e metodi quantitativi 4(2012)
 61. Giacometti , Pianeti(2011) “Extracting joint probability of default from CDS data.” Research report No. 3, DMSIA - University of Bergamo, 2011;
 62. Giacometti , Bertocchi, Rachev, Fabozzi(2010) A comparison of Lee-Carter and an AR-Arch model for forecasting mortality rate technical report University of Karlsruhe;
 63. R.Giacometti, Vespucci; Bertocchi, Barone Adesi (2010) A stochastic model for hedging electricity portfolio for an hydor-energy producer ” DMSIA Working paper N. 2 , Università di Bergamo, 2010;
 64. R. Giacometti. D. Mignacca (2009) “Using Black and Litterman framework for stress testing analysis in asset management” DMSIA Working paper N. 1 , Università di Bergamo, 2009;
 65. Rosella Giacometti, Svetlozar T. Rachev, Vito Sessa, Luca Musicco(2008) ” Funds of Hedge Funds: a Comparison among Different Portfolio Optimization Models implementing the Zero-Investment Strategy “(2008) Technical Reports University of Karlsruhe;
 66. R. Giacometti, Svetlozar Rachev, Anna Chernobai, Marida Bertocchi (2008) “Aggregation Issues in Operational Risk” Technical Reports University of Karlsruhe;
 67. R. Giacometti, S. Rachev, A. Chernobai, M. Bertocchi, G. Consigli,(2007) "Practical Operational Risk", Technical Reports University of Karlsruhe;
 68. F. Maggioni, M.T. Vespucci, S. Gambarini, E. Allevi, M.I. Bertocchi,R. Giacometti & M. Innorta (2007)A stochastic framework for gas retailer based on temperature and oil prices evolution. DMSIA Working paper N. 8 , Università di Bergamo, 2007;
 69. R. Giacometti, M. Bertocchi, S.T. Rachev and F.J. Fabozzi (2005), "Stable distributions in the
-

Black-Litterman approach to the asset allocation", 2005 Technical Reports University of Karlsruhe;

70. Elitropi, Giacometti R (2004). Applicazione degli Algoritmi Genetici per la determinazione di Strategie Ottimali di Trading. In: DMSIA Research Paper, Università di Bergamo . vol. 12
71. Giacometti R, Teocchi M (2004). Pricing Basket Credit Derivatives in a multifactor framework. In: DMSIA Research Paper, Università di Bergamo. vol. 11
72. R Giacometti R. Castellano(2003) "A Bond Portfolio Model with Credit derivatives "DMSIA Working paper N 2, Università di Bergamo, 2004;
73. R. Giacometti, M. Teocchi (2001) "Credit spread options: confronto tra modelli di pricing " DMSIA Working paper N.29, Università di Bergamo 2001;
74. Abbadini B., Giacometti R (2001). A Comparison of Two Linear Models for Portfolio Selection Through an Application to The Italian Stock Market.. In: DMSIA Research Paper, Università di Bergamo. vol. 8
75. Giacometti R, Teocchi M. (2001). Derivati per la copertura del rischio di credito . In: DMSIA Research Paper, Università di Bergamo . vol. 28
76. R. Castellano, R Giacometti (1999) "Performance of a hedged dynamic portfolio model in presence of extreme events "DMSIA Working paper N. 37, Università di Bergamo, 1999
77. R. Castellano, R Giacometti (1999) "Improving portfolio performances using option strategies"DMSIA Working paper N. 18, Università di Bergamo;
78. Bertocchi M., Gamba R, Giacometti R, Lussana C (1999). Gestione integrata di apprendimento in ambiente Matlab: Un'applicazione alla matematica finanziaria classica. In: DMSIA Research Paper, Università di Bergamo. vol. 11
79. Lewney R., Giacometti R, Pinelli D, Fingleton B (1998). European regional Competitiveness indicators. In: Discussion paper, University of Cambridge. vol. 103
80. Giacometti R (1997). La matematica dei titoli a reddito fisso. In: DMSIA Research Paper, Università di Bergamo. vol. 29
81. Giacometti R, Pinelli D (1999). Asymmetric shocks and long-run economic performances across Italian regions. In: DMSIA Research Paper, Università di Bergamo. vol. 19
82. M. Bertocchi, R. Giacometti(1998) "Analisi dei contratti pronti contro termine" DMSIA Working Paper n.28, Università di Bergamo 1998;
83. R. Castellano, R Giacometti (1998), "A Dynamic Multi Currency Portfolio's model". DMSIA Working Paper N.20, Università di Bergamo 1998. Presentato al convegno AMASES 1997.
84. M.Bertocchi, R. Giacometti(1997) "Bond portfolio management with repo contracts: the Italian case(1997) " 'DMSIA Working paper n.21, Università di Bergamo;
85. R Giacometti(1995) " Un modello per la determinazione ottimale delle emissioni di titoli sensibili alle variazioni dei tassi di interesse", Atti del convegno A.M.A.S.E.S. Settembre 1995

HOBBIES

Dal 2013 Presidente della società sportiva di canottaggio ' Rowing Club Cus Bergamo'.

Dal 2018 Allenatore di primo livello della FIC, Federale Italiana Canottaggio .

Io sottoscritta Rosella Giacometti, ai sensi degli art.46 e 47 DPR 445/2000, consapevole delle sanzioni penali previste dall'art.76 del DPR 445/2000 e successive modificazioni ed integrazioni per le ipotesi di falsità in atti e dichiarazioni mendaci, dichiaro sotto mia propria responsabilità la veridicità di tutto quanto dichiarato.



Autorizzo il trattamento dei miei dati personali presenti nel cv ai sensi del Decreto Legislativo 30 giugno 2003, n. 196 "Codice in materia di protezione dei dati personali" e del GDPR (Regolamento UE 2016/679).