

CURRICULUM VITAE ET STUDIORUM

Francesco Cesarone

Domicilio

Via Bagnone, 55
00139 Roma, Italia

Cell: +39 3398147048

Università

Dipartimento di Economia Aziendale,
Università degli Studi di Roma Tre
Via Silvio D'Amico 77, 00145 - Roma, Italia

Tel: +39 0657335744

Fax: +39 0657335797

WWW: <http://host.uniroma3.it/docenti/cesarone/>

Email: francesco.cesarone@uniroma3.it

Dati personali

Luogo e data di nascita: Roma, 04/10/1975

Nazionalità: Italiana

Stato civile: separato

Posizione attuale

Ricercatore universitario confermato nel settore concorsuale 13/D4: metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie - S.S.D. SECS-S/06: metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie presso Università degli Studi Roma Tre, Dipartimento di Economia Aziendale, a decorrere da Marzo 2011.

Conseguimento dell'Abilitazione Scientifica Nazionale a Professore di II fascia nel settore concorsuale 13/D4: metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie - S.S.D. SECS-S/06: metodi matematici dell'economia e delle scienze attuariali e finanziarie, a decorrere da Aprile 2017.

Interessi di ricerca

Problemi di selezione di portafoglio; asset management; modelli di rischio; problemi di index tracking e di enhanced indexation; algoritmi per problemi di programmazione lineare, quadratica mista-intera su larga scala; finanza computazionale; calcolo frazionario; climatologia; calcolo parallelo.

Formazione

Gennaio 2013: Certificato in Advanced Risk and Portfolio Management - "ARPM Certificate" (Attilio Meucci, New York, USA).

Settembre 2010: partecipazione alla Scuola Estiva CASPUR di Calcolo Avanzato, Villa Grazioli, Grottaferrata (Roma).

Luglio 2010: partecipazione alla "International School of Scientific Computation and MATLAB", Palermo - Dipartimento di Scienze Fisiche ed Astronomiche.

Marzo 2010: titolo di Dottore di Ricerca in Matematica per le Applicazioni Economico-Finanziarie (XXII ciclo) presso la Facoltà di Economia - Università di Roma "La Sapienza". Titolo della Tesi: "A New Portfolio Selection Approach: Algorithms, Analysis and Models". Esame finale sostenuto il 26/03/2010.

Novembre 2009: partecipazione alla scuola: "Stochastic Programming School: Theory and Applications", Bergamo - Facoltà di Economia.

Novembre 2006: vincitore borsa di studio per il dottorato di ricerca in Matematica per le Applicazioni Economico-Finanziarie presso la Facoltà di Economia - LUISS (Libera Università Internazionale degli Studi Sociali Guido Carli).

Febbraio 2004: idoneità borsa Italia, bando n. 126.231.Bo.1, presso il CNR-IBIMET sezione di Roma.

2002: laurea in Fisica - Facoltà di Scienze Matematiche, Fisiche e Naturali, Università degli Studi di Roma "La Sapienza".

Tesi: "Modello di diffusione con memoria in membrane biologiche".

Tutor: Prof. Michele Caputo, Prof. Cesare Cametti.

Questo lavoro è stato pubblicato sul *Journal of Membrane Science*: F. Cesarone, M. Caputo, C. Cametti, "Memory formalism in the passive diffusion across a biological membrane" (*Journal of Membrane Science* 250 (2005) 79-84).

1999: corso di imprenditoria giovanile.

Lingue straniere

Buona conoscenza della lingua inglese, scritta e parlata

30 Giugno - 25 Luglio 2008: corso intensivo di Inglese al Language Centre, University of Bristol.

Conoscenze informatiche

Sistemi operativi: Windows, Linux.

Software applicativi: MATLAB, AMPL, Mathematica, Origin, S-Plus, LaTeX, Grid Analysis and Display System (GrADS), Microsoft Office.

Linguaggi di programmazione: R, Fortran, C.

Attività di ricerca scientifica

Publicazioni

1. F. Cesarone, F. Mango, C.D. Mottura, J.M. Ricci, F. Tardella (2020), “On the stability of portfolio selection models”, *Journal of Empirical Finance*, Vol. 59, pag. 210-234, ISSN: 0927-5398, doi: 10.1016/j.jempfin.2020.10.003.
2. F. Cesarone, F. Mango, G. Sabato (2020), “Z-score vs minimum variance preselection methods for constructing small portfolios”. *Investment Management & Financial Innovations*, Vol. 17, pag. 64-76, ISSN: 1810-4967, doi: 10.21511/imfi.17(1).2020.06.
3. F. Bellini, F. Cesarone, C. Colombo, F. Tardella (2020), “Risk Parity with Expectiles”, *European Journal of Operational Research*, ISSN: 0377-2217, doi: 10.1016/j.ejor.2020.10.009.
4. A. Carleo, M. Cenci, F. Cesarone, A. Congedo, M. Corradini, A. Gheno, L. Lampariello, C. Mottura (2020), “Le garanzie statali come strumento di intervento pubblico a sostegno dell’economia: elementi di valutazione finanziaria”. In: (a cura di): M. Paoloni M. Tutino, *L’Italia ai tempi del covid-19*. MILANO: Wolters Kluwer Italia, ISBN: 9788813375478
5. F. Cesarone (2020), “Computational Finance. MATLAB oriented modeling”, pag. 1-238, LONDON: Routledge, ISBN: 9781003045588, doi: 10.4324/9781003045588.
6. A. Giacchero, J. Moretti, F. Cesarone, F. Tardella (2019), “An alternative approach for the operational risk assessment of a new product”, *Journal of Operational Risk*, Vol. 14, pag. 69-95, ISSN: 1744-6740, DOI: 10.21314/JOP.2019.221.
7. F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella (2019). “An optimization-diversification approach to portfolio selection”, *Journal of Global Optimization*, pag. 1-21, ISSN: 0925-5001, doi: 10.1007/s10898-019-00809-7.
8. F. Cesarone, S. Colucci (2018), “Minimum risk versus capital and risk diversification strategies for portfolio construction”, *Journal of the Operational Research Society*, Vol. 69, pag. 183-200, ISSN: 0160-5682, doi: 10.1057/s41274-017-0216-5.
9. F. Cesarone, L. Lampariello, S. Sagratella (2018), “A risk-gain dominance maximization approach to enhanced index tracking”, *Finance Research Letters*, Vol. 29, pag. 231-238, ISSN: 1544-6123, doi: 10.1016/j.frl.2018.08.001.
10. F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella (2018), “A Multi-Greedy Approach to Optimal Diversified Portfolio Selection”, *Available at SSRN: <https://ssrn.com/abstract=3203540>, <http://dx.doi.org/10.2139/ssrn.3203540>*.
11. F. Cesarone, J. Moretti, F. Tardella (2018), “Why small portfolios are preferable and how to choose them”, *The Journal of Financial Perspectives*, Vol. 5(1), pag. 103-116, ISSN 2049-8640.
12. A. Carleo, F. Cesarone, A. Gheno, J.M. Ricci (2017), “Approximating Exact Expected Utility via Portfolio Efficient Frontiers”, *Decisions in Economics and Finance*, Vol. 40(1-2), pag. 115-143, DOI: 10.1007/s10203-017-0201-0.

13. R. Bruni, F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella (2017), “On Exact and Approximate Stochastic Dominance Strategies for Portfolio Selection”, *European Journal of Operational Research*, Vol. 259(1), pag. 322-329, DOI: 10.1016/j.ejor.2016.10.006.
14. F. Cesarone and F. Tardella (2017), “Equal Risk Bounding is better than Risk Parity for portfolio selection”, *Journal of Global Optimization*, Vol. 68(2), pag. 439-461, DOI: 10.1007/s10898-016-0477-6.
15. F. Cesarone, S. Colucci (2016), “A Quick Tool to Forecast VaR Using Implied and Realized Volatilities”, *The Journal of Risk Model Validation*, Vol. 10(4), pag. 71-101, DOI: 10.21314/JRMV.2016.163.
16. F. Cesarone, J. Moretti, F. Tardella (2016), “Optimally chosen small portfolios are better than large ones”, *Economics Bulletin*, Vol. 36(4), pag. 1876-1891, ISSN 1545-2921.
17. R. Bruni, F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella, (2016), “Real-world datasets for portfolio selection and solutions of some stochastic dominance portfolio models”, *Data in Brief*, Vol. 8, pag. 858-862, doi:10.1016/j.dib.2016.06.031.
18. F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella, (2015), “Linear vs. quadratic portfolio selection models with hard real-world constraints”, *Computational Management Science*, Vol. 12(3), pag. 345-370, ISSN: 1619-6988, doi: 10.1007/s10287-014-0210-1.
19. R. Bruni, F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella, (2015), “A Linear Risk-Return Model for Enhanced Indexation in Portfolio Optimization”, *OR Spectrum*, Vol. 37(3), pag. 735-759, ISSN: 1436-6304, DOI: 10.1007/s00291-014-0383-6.
20. F. Cesarone, J. Moretti, F. Tardella, (2014), “Does Greater Diversification Really Improve Performance in Portfolio Selection?”, *Available at SSRN: <http://ssrn.com/abstract=2473630>, <http://dx.doi.org/10.2139/ssrn.2473630>.*
21. F. Cesarone and F. Tardella (2014), “Equal risk bounding is better than risk parity for portfolio selection”, *Advanced Risk & Portfolio Management Research Paper Series 4*, Available at SSRN: <http://ssrn.com/abstract=2412559>.
22. F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella (2013), “A new method for Mean-Variance portfolio optimization with cardinality constraints”, *Annals of Operations Research*, Vol. 205(1), pag. 213–234, ISSN: 1572-9338, doi: 10.1007/s10479-012-1165-7.
23. F. Cesarone, A. Gheno, F. Tardella, (2013), “Learning and Holding Periods for Portfolio Selection: a Sensitivity Analysis”, *Applied Mathematical Sciences*, Vol. 7(100), pag. 4981-4999, <http://dx.doi.org/10.12988/ams.2013.37428>, ISSN 1312-885X.
24. R. Bruni, F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella (2013), “No arbitrage and a linear portfolio selection model”, *Economics Bulletin*, Vol. 33(2), pag. 1247-1258, ISSN 1545-2921.
25. R. Bruni, F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella (2012), “A new stochastic dominance approach to enhanced index tracking problems”, *Economics Bulletin*, Vol. 32(4), pag. 3460-3470, ISSN 1545-2921.

26. R. Bruni, F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella (2012), "A New LP Model for Enhanced Indexation", *Working papers of Department of Economics - University of Roma Tre* - online, ISSN 2279-6916.
27. F. Cesarone, A. Scozzari, F. Tardella, "Efficient Algorithms For Mean-Variance Portfolio Optimization With Hard Real-World Constraints", *Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari*, Vol. 72 (2009), pag. 37-56, ISSN: 0390-5780.
28. M. Baldi, F. Cesarone, G. A. Dalu, F. Cannata (2006), "Mitigation and Recover of Semi-arid and Arid Provinces in China", *Acta Horticulturae*, Vol. 705, p. 47-54, ISSN: 0567-7572.
29. M. Baldi, G. Dalu, G. Maracchi, M. Pasqui, F. Cesarone (2006), "Heat waves in the Mediterranean: a local feature or a larger-scale effect?", *International Journal of Climatology*, Vol. 26, p. 1477-1487, ISSN: 0899-8418, doi: 10.1002/joc.1389.
30. F. Cesarone, M. Caputo, C. Cametti (2005), "Memory formalism in the passive diffusion across highly heterogeneous systems", *Journal of Membrane Science*, Vol. 250, pag. 79-84, ISSN: 0376-7388, doi: 10.1016/j.memsci.2004.10.018.

Proceedings e manoscritti

31. M. Baldi, F. Cesarone, G.A. Dalu, G. Maracchi, F. Meneguzzo, "Rainfall variability over the Mediterranean Region and its linkage with large scale features", *Proceedings of the 14th International Conference on Clouds and Precipitation ICCP*, Bologna, July 2004.
32. F. Cesarone, "Modellistica dei campi di precipitazione sull'Area Mediterranea", technical report for ASI - MeditRain project (2003).
33. Dalu G.A., F. Cesarone, M. Baldi, M. Gaetani, "Climate extreme and variability related to forestry land-cover and agriculture land-use changes", Sino-Italian workshop on sustainable forestry, agro forestry and food technology, Beijing (China), November 2005.
34. M. Baldi, M. Pasqui, F. Cesarone, and G. De Chiara, "Heat waves in the Mediterranean Region: Analysis and model results", *Proceedings of the American Meteorological Society 16th Symposium on Global Change and Climate Variations*, San Diego, CA, 9 - 13 January 2005.
35. M. Baldi, L. Genesisio, F. Meneguzzo, F. Cesarone, and F. Piani, "Role of the Monsoons Variability on the Summer Drought events in the Mediterranean Basin", *Proceedings of the American Meteorological Society 16th Symposium on Global Change and Climate Variations*, San Diego, CA, 9 - 13 January 2005.
36. F. Cesarone, "Analisi e modellazione della variabilità climatologica del Bacino Mediterraneo tramite uso di dati di osservazione reale e di rianalisi", report for CLIMAGRI project (2004).

Attività di revisione e valutazione

Collaborazione come revisore per le seguenti riviste: *Quantitative Finance*, *Journal of the Operational Research Society*, *European Journal of Operational Research*, *Computational Management Science*, *Computers & Operations Research*, *Decisions in Economics and Finance*, *Optimization Letters*, *Applied Mathematics and Computation*, *Computing Surveys*.

Comitati Scientifici

dal 2018 ad oggi - Membro del Comitato Scientifico dei seguenti convegni: XIX Workshop on Quantitative Finance, Roma, 24-26 Gennaio 2018; XX Workshop on Quantitative Finance, Zurigo (Svizzera), 23-25 Gennaio 2019; XXI Workshop on Quantitative Finance, Napoli, 29-31 Gennaio 2020; XXII Workshop on Quantitative Finance, Verona, 28-29 Gennaio 2021.

Organizzazione di conferenze nazionali e internazionali

Gennaio 2018: ORGANIZZAZIONE del convegno “XIX Workshop on Quantitative Finance (QFW2018)”, Roma, Italia.

Maggio 2009: membro del comitato organizzativo per l’International Conference NET2009 evolution and complexity and COST-ESF workshop on Physics of Competition and Conflicts, Roma, Italia.

Direzione o partecipazione alle attività di un gruppo di ricerca caratterizzato da collaborazioni a livello nazionale o internazionale

1. Partecipazione al progetto di ricerca PRIN 2017 (codice progetto: 20177WC4KE, settore - SH2 linea intervento A) dal titolo: “FinTech: the influence of enabling technologies on the future of the financial markets”. Principal investigator: Prof.ssa Antonella Maria Sciarrone. Dal 01-03-2020 a oggi.
2. Coordinatore e Responsabile Scientifico del Progetto di Ricerca presso l’Università di Studi Roma Tre, Dipartimento di Economia Aziendale. Titolo: “Risk Allocation for Portfolio Selection”. Dal 16-12-2019 al 16-05-2020.
3. Coordinatore e Responsabile Scientifico del Progetto di Ricerca presso l’Università di Studi Roma Tre, Dipartimento di Economia Aziendale. Titolo: “Portfolio Selection and Efficient Frontiers”. Dal 01-03-2016 al 01-07-2016.
4. Partecipazione al Progetto di Ricerca “Ricerche Universitarie” (2015) Sapienza, Università di Roma Titolo: “La selezione di portafoglio: ottimizzazione, diversificazione e valutazione delle performance”. Responsabile: Prof. Fabio Tardella. Le date specificate nel format devono intendersi approssimative. Dal 01-10-2015 al 01-03-2017.
5. Coordinatore e Responsabile Scientifico del Progetto di Ricerca presso l’Università di Studi Roma Tre, Dipartimento di Economia Aziendale. Titolo: “Risk Diversification Strategies for Portfolio Construction”. Dal 02-03-2015 al 01-07-2015.

6. Partecipazione al Progetto di Ricerca “Ricerche Universitarie” (2014) Sapienza, Università di Roma Titolo: “Indicatori e modelli per l’analisi della concentrazione nei mercati finanziari”. Responsabile: Prof.ssa Giulia Rotundo. Dal 21-11-2014 al 2016.
7. Coordinatore e Responsabile Scientifico del Progetto di Ricerca presso l’Università di Studi Roma Tre, Dipartimento di Studi Aziendali. Titolo: “Risk Parity approach for Portfolio Selection”. Dal 03-03-2014 al 01-07-2014.
8. Partecipazione al Progetto di Ricerca “Ricerche Universitarie” (2013) Sapienza, Università di Roma Titolo: “Stabilità nei mercati finanziari: analisi, modelli ed algoritmi”. Responsabile: Prof.ssa Giulia Rotundo. Dal 09-12-2013 al 08-06-2015.
9. Partecipazione al Progetto di Ricerca “Ricerche Universitarie” (2011) Sapienza, Università di Roma Titolo: “Modelli di ottimizzazione in finanza”. Responsabile: Prof. Fabio Tardella. Le date specificate nel format devono intendersi approssimative. Dal 01-01-2011 al 31-12-2012.
10. Coordinatore e Responsabile Scientifico del Progetto di Ricerca presso l’Università di Studi Roma Tre, Dipartimento di Economia. Titolo: “Modelli di selezione di portafogli azionari” (2012).
11. Partecipazione al Progetto di Ricerca “Ricerche Universitarie” (2011) Sapienza, Università di Roma Titolo: “Algoritmi di ottimizzazione al servizio del legislatore: procedure corrette ed efficienti per l’allocazione dei seggi nei sistemi elettorali biproporzionali”. Responsabile: Dott.ssa Federica Ricca. Le date specificate nel format devono intendersi approssimative. Dal 01-01-2011 al 31-12-2012.
12. Contratto di collaborazione coordinata e continuativa per lo “Sviluppo di algoritmi efficienti per la risoluzione di problemi di selezione di portafoglio computazionalmente difficili” nell’ambito della ricerca “Ottimizzazione discreta: nuovi trend applicativi nelle discipline economiche, finanziarie e sociali” presso il Dipartimento di Statistica, Probabilità e Statistiche Applicate, Università di Roma “La Sapienza”. Responsabile scientifico: Dott.ssa Federica Ricca. Dal 01-06-2010 al 15-08-2010.
13. Assegno di ricerca presso il Dipartimento di Matematica per le Decisioni Economiche, Finanziarie ed Assicurative, Facoltà di Economia, Università di Roma La Sapienza. Titolo della Ricerca: Modelli di selezione di portafoglio: aspetti teorici, computazionali e applicativi”. Responsabile scientifico: Prof. Fabio Tardella. Dal 01-06-2010 al 15-03-2011.
14. Partecipazione al Progetto di ricerca CASPUR “Standard HPC Grant 2010” Titolo: “Algoritmi Paralleli per problemi di scelta di portafoglio computazionalmente difficili” Responsabile: Andrea Scozzari Dal 01-01-2010 al 31-12-2010.
15. Partecipazione al Progetto di Ricerca “Ricerche Universitarie” (2010) Sapienza, Università di Roma Titolo: “Analisi e ottimizzazione di portafogli e di reti azionarie”. Responsabile: Prof. Fabio Tardella. Le date specificate nel format devono intendersi approssimative. Dal 01-01-2010 al 31-12-2011.
16. Partecipazione ad attività di ricerca presso il ‘Department of Mathematical Sciences - Brunel University’ (London). Dal 10-01-2009 al 30-04-2009.

17. Partecipazione al Progetto di Ricerca “Ricerche Universitarie” (2008) Università di Roma “La Sapienza” Titolo: “Modelli di ottimizzazione e di matematica discreta per la finanza e la previdenza” Responsabile: Prof. Fabio Tardella. Le date specificate nel format devono intendersi approssimative. Dal 01-01-2008 al 31-12-2010.

Altre collaborazioni ad attività di ricerca tramite assegni, contratti e borse di studio

Novembre 2006 - Ottobre 2009: borsa di studio relativa al dottorato di ricerca in Matematica per le Applicazioni Economico-Finanziarie presso la Facoltà di Economia - Università di Roma “La Sapienza”.

Marzo 2005 - Dicembre 2005: contratto di lavoro a progetto per la ricerca in modelli matematico-statici per la Società NEC Italia (Società di Ricerca e Progettazione Ambientale) presso IBIMET - CNR sez. di Roma.

Settembre 2004 - Febbraio 2005: assegno di ricerca nell’ambito del progetto Climagri presso IBIMET - CNR sez. di Roma.

Gennaio 2004 - Agosto 2004: prestazione professionale di ricerca nell’ambito del progetto Climagri presso IBIMET - CNR sez. di Roma.

Luglio 2003 - Dicembre 2003: contratto di collaborazione coordinata e continuativa per la ricerca di connessioni fra eventi di precipitazione in area Mediterranea e processi atmosferici a grande scala presso la Fondazione per la Meteorologia Applicata.

Responsabilità di studi e ricerche scientifiche affidati da qualificate istituzioni pubbliche o private

1. Responsabile di studi e ricerche per lo sviluppo di nuovi strumenti computazionali riguardanti problemi di Risk Management e Portfolio Management presso la SYMMYS LLC (ora ARPM, Advanced Risk and Portfolio Management) di Attilio Meucci con sede in New York (US). Dal 18-02-2013 al 30-09-2013.

Responsabilità scientifica per progetti di ricerca internazionali e nazionali, ammessi al finanziamento sulla base di bandi competitivi che prevedano la revisione tra pari

1. Coordinatore e responsabile del progetto “XIX Workshop on Quantitative Finance”. Vincitore del BANDO ACRI “YOUNG INVESTIGATOR TRAINING PROGRAM 2017”. Dal 24-01-2018 al 16-03-2018.
2. Coordinatore e Responsabile Scientifico del Progetto di Ricerca finanziato dall’Ateneo Roma Tre tramite il Bando di Internazionalizzazione 2011 e supportato dalla Brunel University (London) e dal centro di ricerca CARISMA (Centre for the Analysis of Risk and Optimisation Modelling Applications, London). Titolo: “MODELLI MATEMATICI E PROCEDURE COMPUTAZIONALI PER PROBLEMI DI FINANZA QUANTITATIVA”. Dal 01-01-2012 al 30-06-2013.

Partecipazione come relatore a convegni nazionali e internazionali

1. Partecipazione come relatore al Convegno “Finance in the Dynamic NETWORK Society & Small Island Economies - FIDNES2019” con una comunicazione dal titolo “Z-score vs Markowitz preselection for constructing small portfolios”, CURACAO. Dal 07-11-2019 al 09-11-2019.
2. Partecipazione come relatore al Convegno “International Conference on Optimization and Decision Science - ODS2019” con una comunicazione dal titolo “Risk Parity with Expectiles”, Genova, Italia. Dal 04-09-2019 al 07-09-2019.
3. Partecipazione come relatore al Convegno 30th European Conference on Operational Research con una comunicazione dal titolo “Risk Parity with Expectiles”, Dublino, Irlanda. Dal 23-06-2019 al 26-06-2019.
4. Partecipazione come relatore al Convegno “XX Workshop on Quantitative Finance” con una comunicazione dal titolo “Risk Parity with Expectiles”, Zurigo, Svizzera. Dal 23-01-2019 al 25-01-2019.
5. Partecipazione come relatore al Convegno 29th European Conference on Operational Research con una comunicazione dal titolo “On the stability of portfolio selection models”, Valencia, Spagna. Dal 08-07-2018 al 11-07-2018.
6. Partecipazione come relatore al Convegno AMASES 2017 con una comunicazione dal titolo “Diversified Optimal Portfolios: a new approach to portfolio selection”, Cagliari, Italia. Dal 14-09-2017 al 16-09-2017.
7. Partecipazione come relatore al Convegno “Innovations in Insurance, Risk- and Asset Management” con una comunicazione dal titolo “Joining Diversification and Optimization for Asset Allocation”, Monaco, Germania. Dal 05-04-2017 al 07-04-2017.
8. Partecipazione come relatore al Convegno “XVIII Workshop on Quantitative Finance” con una comunicazione dal titolo “Diversification+Optimization=Portfolio Selection”, Milano, Italia. Dal 25-01-2017 al 27-01-2017.
9. Partecipazione come relatore al Convegno “International Rome Conference on Money, Banking and Finance XXV Edition” con una comunicazione dal titolo “Improving the Risk Parity Approach to Portfolio Selection”, Roma, Italia. Dal 01-12-2016 al 02-12-2016.
10. Partecipazione come relatore al Convegno AMASES 2016 con una comunicazione dal titolo “Exact and Approximate Stochastic Dominance for Portfolio Selection”, Catania, Italia. Dal 15-09-2016 al 17-09-2016.
11. Partecipazione come relatore al Convegno XVII Workshop on Quantitative Finance con una comunicazione dal titolo “On Exact and Approximate Stochastic Dominance Strategies for Portfolio Selection”, Pisa, Italia. Dal 28-01-2016 al 29-01-2016.
12. Partecipazione come relatore al Convegno XVI Workshop on Quantitative Finance con una comunicazione dal titolo “Does Greater Diversification Really Improve Performance in Portfolio Selection?”, Parma, Italia. Dal 29-01-2015 al 30-01-2015.

13. Partecipazione come relatore al Convegno XV Workshop on Quantitative Finance con una comunicazione dal titolo “Risk Bounding is better than Risk Parity for portfolio selection”, Firenze, Italia. Dal 23-01-2014 al 24-01-2014.
14. Partecipazione come relatore al Convegno 26th European Conference on Operational Research con una comunicazione dal titolo “Risk disparity is better than risk parity for portfolio selection”, Roma, Italia. Dal 01-07-2013 al 04-07-2013.
15. Partecipazione come relatore al Convegno XIV Workshop on Quantitative Finance con una comunicazione dal titolo “A Practically Realizable Strong Stochastic Dominance Model for Enhanced Indexation”, Rimini, Italia. Dal 24-01-2013 al 25-01-2013.
16. Partecipazione come relatore al Convegno 25th European Conference on Operational Research con una comunicazione dal titolo “A Risk-Return Approach to Enhanced Indexation”, Vilnius, Lithuania. Dal 08-07-2012 al 11-07-2012.
17. Partecipazione come relatore al Convegno XIII Workshop on Quantitative Finance con una comunicazione dal titolo “A Linear Risk-Return Model for Enhanced Indexation”, L’Aquila, Italia. Dal 26-01-2012 al 27-01-2012.
18. Partecipazione come relatore al Convegno 24th European Conference on Operational Research con una comunicazione dal titolo “A new portfolio selection approach: Models and Algorithms”, Lisbon, Portugal. Chair della sessione Financial Optimization. Dal 11-07-2010 al 14-07-2010.
19. Partecipazione come relatore al Convegno 5th Annual Meeting of the European Meteorological Society con una comunicazione dal titolo “Mediterranean Jetstream and Mediterranean Winter Anomalies”, Utrecht, the Netherlands. Dal 12-09-2005 al 16-09-2005.
20. Partecipazione come relatore al Convegno 5th International Walnut Symposium con una comunicazione dal titolo “Mitigation and Recover of Semi-Arid and Arid Regions in China”, Sant’Agnello di Sorrento (Napoli), Italia. Dal 09-11-2004 al 13-11-2004.

Awards

Settembre 2005: *Young Scientist Travel Award awarded by the European Meteorological Society* for outstanding contribution to the 5th Annual Meeting of the EMS, Utrecht, The Netherlands.

Seminari su invito

- 14-03-2018: Risk Diversification and Portfolio Selection, “Research meeting”, Università di Milano-Bicocca.
- 26-05-2017: Old and new frameworks for portfolio selection, “PhD in Economics Seminar Series 2017”, Università di Perugia.
- 18-01-2017: Old and new frameworks for portfolio selection, “Research meeting”, Università di Tor Vergata.

Attività didattica

Insegnamenti e moduli svolti

dall'a.a. 2018-2019 al presente: Titolare del Corso di Financial Modeling (9 CFU - Laurea Magistrale percorso in inglese) presso l'Università degli Studi Roma Tre, Scuola di Economia e Studi Aziendali.

dall'a.a. 2013-2014 al presente: Titolare del Corso di Finanza Computazionale (9 CFU - Laurea Magistrale) presso l'Università degli Studi Roma Tre, Scuola di Economia e Studi Aziendali.

a.a. 2014-2015: Titolare del Corso di Matematica Finanziaria (8 CFU - Laurea Triennale) presso l'Università degli Studi della Tuscia.

a.a. 2011-2012 e 2012-2013: Titolare del Corso di Modelli Matematici dei Mercati Finanziari (9 CFU - Laurea Triennale) presso l'Università di Roma Tre, Facoltà di Economia.

dall'a.a. 2010-2011 all'a.a. 2012-2013: Titolare di un modulo del Corso di Metodi matematici per le decisioni economiche e aziendali (9 CFU - Laurea Magistrale) presso l'Università degli Studi Roma Tre, Facoltà di Economia.

a.a. 2010-2011: Pre-corso di Matematica generale presso la Facoltà di Economia - Università di Roma Tre - *docenza a contratto*.

dall'a.a. 2009-2010 all'a.a. 2013-2014: Corso integrativo di Ricerca Operativa nell'ambito dell'insegnamento di Metodi Quantitativi per il Management (9 CFU - Laurea Magistrale) presso la Facoltà di Economia - LUISS (Libera Università Internazionale degli Studi Sociali Guido Carli) - *docenza a contratto*.

dall'a.a. 2009-2010 all'a.a. 2012-2013: Esercitazioni di Matematica Finanziaria tramite Excel presso la Facoltà di Economia - LUISS (Libera Università Internazionale degli Studi Sociali Guido Carli) - *docenza a contratto*.

a.a. 2010-2011: Insegnamento di Gestione finanziaria e strumenti informatici per la previdenza - presso la Facoltà di Economia - Università di Roma "La Sapienza" - *docenza a contratto*.

a.a. 2008-2009 e 2009-2010: Insegnamento di Informatica 2 - Introduzione al Calcolo Finanziario tramite MATLAB presso la Facoltà di Economia - Università di Roma Tre - *docenza a contratto*.

dall'a.a. 2007-2008 all'a.a. 2009-2010: Esercitazioni di Matematica Corso Base presso la Facoltà di Economia - Università di Roma "La Sapienza" - *docenza a contratto*.

a.a. 2008-2009: Corso integrativo di Teoria del Portafoglio nell'ambito dell'insegnamento di Metodi Quantitativi per il Management presso la Facoltà di Economia - LUISS (Libera Università Internazionale degli Studi Sociali Guido Carli) - *docenza a contratto*.

a.a. 2006-2007: Esercitazioni di Matematica Generale presso la Facoltà di Economia - Università di Roma "La Sapienza" - *con assegno di collaborazione per attività didattico-integrativa*.

da Ottobre 2002 a Giugno 2003: Docenze nelle scuole superiori.

Partecipazione a commissioni istituite per esami di profitto

dal 2013 ad oggi: Partecipazione alle seguenti commissioni d'esame: *Finanza Computazionale, Financial Modelling, Matematica Finanziaria, Informatica* presso il Dipartimento di Economia Aziendale - Università di Roma Tre.

dal 2008 ad oggi: Partecipazione a tutte le commissioni d'esame relative agli insegnamenti e ai moduli elencati nella sezione "**Insegnamenti e moduli svolti**".

Quantità e qualità dell'attività di tipo seminariale, di quella mirata alle esercitazioni e al tutoraggio degli studenti, e assistenza alla predisposizione di tesi di laurea magistrale

dal 2013 ad oggi: nell'ambito dei corsi di *Finanza Computazionale* e *Financial Modelling* (Laurea Magistrale in Finanza e Impresa - Università di Roma Tre), durante il periodo di didattica, svolgimento di attività quotidiane mirate alle esercitazioni e al tutoraggio degli studenti. In aggiunta, durante tutto l'anno accademico, 1-2 pomeriggi a settimana sono dedicati al ricevimento studenti.

dal 2013 ad oggi: Organizzazione di numerose attività seminariali nell'ambito dei corsi di *Finanza Computazionale* e *Financial Modelling* - Laurea Magistrale in Finanza e Impresa - Università di Roma Tre (almeno 2 seminari di alto profilo per ciascun insegnamento e per ciascun anno accademico).

dal 2011 ad oggi: Supervisione di numerose tesi di Laurea Magistrale in Finanza e Impresa, Università di Roma Tre.

Partecipazione al collegio dei docenti ovvero attribuzione di incarichi di insegnamento, nell'ambito di dottorati di ricerca accreditati dal Ministero

Partecipazione al collegio dei docenti del corso di dottorato in Mercati, Impresa e Consumatori. Dal 15-07-2016 a oggi.

Supervisor della tesi di dottorato di Stefano Colucci (XXXI Ciclo, Università di Roma Tre). Titolo: "Risk and asset management models: theoretical and practical aspects".

Supervisor della tesi di dottorato di Jacopo Maria Ricci (XXXII Ciclo, Università di Roma Tre). Titolo: "Some New Perspectives on Portfolio Selection Models".

Il sottoscritto, consapevole che – ai sensi dell'art. 76 del D.P.R. 445/2000 – le dichiarazioni mendaci, la falsità negli atti e l'uso di atti falsi sono puniti ai sensi del codice penale e delle leggi speciali, dichiara che le informazioni rispondono a verità. Il sottoscritto in merito al trattamento dei dati personali esprime il proprio consenso al trattamento degli stessi nel rispetto delle finalità e modalità di cui al d.lgs. n. 196/2003.

Luogo e data **ROMA, 10/02/2021**


il dichiarante