

INFORMAZIONI PERSONALI

Giovanni Puccetti, nato il 16/12/1978 a Viareggio (LU)

POSIZIONE RICOPERTA

Professore Associato *a tempo pieno* per il settore concorsuale 13/D4 (SECS-S/06) presso l'Università degli Studi di Milano, Dipartimento di Economia, Management e Metodi Quantitativi.

Abilitazione scientifica nazionale come Professore di I fascia per i settori:

- 13/D4 - Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie (valida dal 5/4/2017 al 5/04/2023)

- 13/D1- Statistica (valida dal 31/03/2017 al 31/03/2023)

email: giovanni(dot)puccetti(at)unimi(dot)it

web: <https://sites.google.com/site/giovannipuccetti>

ESPERIENZA PROFESSIONALE

01/04/2015-31/03/2016

Ricercatore Universitario 13/D4 (SECS-S/06) presso l'Università degli Studi di Milano

01/01/2005-31/03/2015

Ricercatore Universitario 13/D4 (SECS-S/06) presso l'Università degli Studi di Firenze

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

2005

Dottorato di Ricerca in Matematica per le Decisioni Economiche conseguito presso l'Università di Pisa

2001

Laurea con lode in Scienze Statistiche ed Attuariali conseguita presso l'Università degli Studi di Firenze (premio *G. Parenti* come miglior laureato della Facoltà di Economia).

INCARICHI DI INSEGNAMENTO O RICERCA ALL'ESTERO

01-05-2013 / 04-08-2013

Visiting assistant professor con incarico di insegnamento del corso "ACTSC634: Quantitative Risk Management" presso l'Università di Waterloo, Canada

16-02-2009 / 29-05-2009

Visiting Professor presso l'ETH di Zurigo, Svizzera

19-02-2008 / 16-05-2008

Visiting Professor presso l'ETH di Zurigo, Svizzera

01-10-2004 / 29-12-2004

Research Project Assistant presso l'ETH di Zurigo, Svizzera

COMPETENZE PERSONALI

Lingua madre

Italiano

Altre lingue	AUTOVALUTAZIONE				
	COMPRESIONE		PARLATO		PRODUZIONE SCRITTA
	Ascolto	Lettura	Interazione	Produzione orale	
Inglese	C2	C2	C2	C2	C2

Competenze comunicative ▪ possiedo eccellenti competenze comunicative acquisite durante la mia esperienza come speaker a convegni internazionali e professore universitario.

Competenze organizzative e gestionali ▪ organizzazione di eventi scientifici dal design di logo e sito web alla realizzazione pratica acquisita come organizzatore di numerosi eventi scientifici. Esperienza manageriale in campo editoriale come Editore responsabile di una rivista scientifica internazionale.

Competenze digitali	AUTOVALUTAZIONE				
	Elaborazione delle informazioni	Comunicazione	Creazione di Contenuti	Sicurezza	Risoluzione di problemi
	Utente Avanzato	Utente Avanzato	Utente Avanzato	Utente Avanzato	Utente Avanzato

- buona padronanza degli strumenti della suite per ufficio (elaboratore di testi, foglio elettronico, software di presentazione)
- buona padronanza di Photoshop acquisita come fotografo a livello amatoriale
- eccellente padronanza dei linguaggi di programmazione MatLab, C++, R usati per la Ricerca Scientifica

Patente di guida B

ULTERIORI INFORMAZIONI

Metriche Bibliografiche
Al 6/11/2018

Scopus: DOCS: 35 CITS: 574 H-INDEX: 14
WoS: DOCS: 32 CITS: 480 H-INDEX: 13
Google Scholar: DOCS: 43 CITS: 1395 H-INDEX: 20

PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE

31 Di Lascio, F. M. L., Giammusso, D. and G. Puccetti (2018). A clustering approach and a rule of thumb for risk aggregation. *Journal of Banking and Finance* 96, 236-248.

30 Bellini, F., Bignozzi, V. and G. Puccetti (2018). Conditional expectiles, time consistency and mixture convexity properties. *Insurance Mathematics & Economics* 82, 117-123.

29 Puccetti, G., Rigo, P., Wang, B. and R. Wang (2018). Centers of probability measures without the mean. *Journal of Theoretical Probability*, in press.

28 Puccetti, G. (2017). An algorithm to approximate the optimal expected product of two vectors with given marginals. *Journal of Mathematical Analysis and Applications* 451, 132-145.

27 Puccetti, G., Rüschenndorf, L., Small, D., and S. Vanduffel (2017). Reduction of Value-at-Risk bounds via independence and variance information. *Scandinavian Actuarial Journal* 2017(3), 245-266.

26 Puccetti, G., Rüschenndorf, L. and D. Manko (2016). VaR bounds for joint portfolios with dependence constraints. *Dependence Modeling* 4, 368-381.

- 25 Puccetti, G. and R. Wang (2015). Extremal dependence concepts. *Statistical Science* 30(4), 485-517.
- 24 Bignozzi, V. and G. Puccetti (2015). Studying mixability with supermodular aggregating functions. *Statistics & Probability Letters*, 100, 48-55.
- 23 Bignozzi, V., Puccetti, G., and L. Rüschendorf (2015). Reducing model risk via positive and negative dependence assumptions. *Insurance Mathematics & Economics*, 61(1), 17-26.
- 22 Puccetti, G. and R. Wang (2015). Detecting complete and joint mixability. *Journal of Computational and Applied Mathematics*, 280, 174-187.
- 21 Puccetti, G. and L. Rüschendorf (2015). Computation of sharp bounds on the expected value of a supermodular function of risks with given marginals. *Communications in Statistics - Simulation and Computation*, 44 (3), 705-718.
- 20 Aas, K. and G. Puccetti (2014). Bounds for total economic capital: the DNB case study. *Extremes*, 17(4), 693-715.
- 19 Embrechts, P., Puccetti, G., Rüschendorf, L., Wang, R. and A. Beleraj (2014). An Academic Response to Basel 3.5. *Risks*, 2(1), 25-48.
- 18 Puccetti, G. and L. Rüschendorf (2014). Asymptotic equivalence of conservative value-at-risk- and expected shortfall-based capital charges. *The Journal of Risk*, 16(3), 3-22
- 17 Puccetti, G., Wang, B., and R. Wang (2013). Complete mixability and asymptotic equivalence of worst-possible VaR and ES estimates. *Insurance Mathematics & Economics*, 53(3), 821-828
- 16 Embrechts, P., Puccetti, G. and L. Rüschendorf (2013). Model uncertainty and VaR aggregation. *Journal of Banking and Finance*, 37(8), 2750-2764.
- 15 Puccetti, G. and L. Rüschendorf (2013). Sharp bounds for sums of dependent risks. *Journal of Applied Probability*, 50(1), 42-53.
- 14 Puccetti, G. (2013). Sharp bounds on the expected shortfall for a sum of dependent random variables. *Statistics & Probability Letters*, 83(4), 1227-1232.
- 13 Arbenz, P., Embrechts, P., and G. Puccetti (2012). The GAEP algorithm for the fast computation of the distribution of a function of dependent random variables. *Stochastics*, 84(5-6), 569-597.
- 12 Puccetti, G. and L. Rüschendorf (2012). Bounds for joint portfolios of dependent risks. *Statistics & Risk Modeling*, 29(2), 107-132.
- 11 Puccetti, G., Wang, B., and R. Wang (2012). Advances in complete mixability. *Journal of Applied Probability*, 49(2), 430-440.
- 10 Puccetti, G. and L. Rüschendorf (2012). Computation of sharp bounds on the distribution of a function of dependent risks. *Journal of Computational and Applied Mathematics*, 236 (7), 1833-1840.
- 9 Arbenz, P., Embrechts, P., and G. Puccetti (2011). The AEP algorithm for the fast computation of the distribution of the sum of dependent random variables. *Bernoulli*, 17(2), 562-591.
- 8 Embrechts, P. and G. Puccetti (2010). Risk Aggregation. In P.Jaworski et al. (eds.), *Copula Theory and Its Applications*, Lecture Notes in Statistics 198, Springer, Berlin/Heidelberg
- 7 Embrechts, P. and G. Puccetti (2010). Bounds for the sum of dependent risks having overlapping marginals. *Journal of Multivariate Analysis*, 101(1), 177-190.
- 6 Puccetti, G. and M. Scarsini (2010). Multivariate comonotonicity. *Journal of Multivariate Analysis*, 101(1), 291-304.
- 5 Embrechts, P. and G. Puccetti (2008). Aggregating operational risk across matrix structured loss data: the case of operational risk, *The Journal of Operational Risk*, 3(2), 29-44.

- 4 Embrechts, P. and G. Puccetti (2006). Aggregating risk capital, with an application to operational risk. *The Geneva Risk and Insurance Review*, 31(2), 71-90.
- 3 Embrechts, P. and G. Puccetti (2006). Bounds for functions of multivariate risks. *Journal of Multivariate Analysis*, 97(2), 526-547.
- 2 Embrechts, P. and G. Puccetti (2006). Bounds for functions of dependent risks. *Finance & Stochastics*, 10(3), 341-352.
- 1 Embrechts, P., Höing, A., and G. Puccetti (2005). Worst VaR scenarios. *Insurance Mathematics & Economics* 37(1), 115-134.

 PUBBLICAZIONI
 DIVULGATIVE
 (INTERVISTE)

- 17 Puccetti, G. and M. Scherer (2018). Copulas, credit portfolios, and the broken heart syndrome. *Dependence Modeling* 6, 114-130.
- 16 Durante, F., Puccetti, G., Scherer, M. and S. Vanduffel (2017). The Vine Philosopher. *Dependence Modeling* 5, 256-267.
- 15 Durante, F., Puccetti, G., Scherer, M. and S. Vanduffel (2017). My introduction to copulas. *Dependence Modeling*, 5, 88-98.
- 14 Durante, F., Puccetti, G., Scherer, M. and S. Vanduffel (2016). Distributions with given marginals: the beginnings. *Dependence Modeling*, 4(1), 237-250.

 Tradotta in Italiano in "Distribuzioni con marginali assegnate: gli inizi." (2017) *Lettera Matematica Pristem* 101, 4-16.
- 13 Durante, F., Puccetti, G., Scherer, M. and S. Vanduffel (2016). Stat Trek. *Dependence Modeling*, 4(1), 109-122.
- 12 Durante, F., Puccetti, G. & Scherer, M. (2015). A Journey from Statistics and Probability to Risk Theory. *Dependence Modeling*, 3(1), 182-195.
- 11 Durante, F., Puccetti, G. & Scherer, M. (2015). Building bridges between Mathematics, Insurance and Finance. *Dependence Modeling*, 3(1), 17-28.

 Tradotta in Tedesco in "Die Copulae fanden mich ... " (2015) *Risiko Manager* 17, 23-28.

 Tradotta in Cinese in "架起数学、保险与金融的桥"(2015) *Actuarial Communications* 10(2), 26-35.

 PARTECIPAZIONE COME RELATORE
 INVITATO A CONVEGNI DI CARATTERE
 SCIENTIFICO (dal 2008)

- | | |
|-------------------------|---|
| 11-9-2017 / 14-9-2017 | Risk Measurement and Regulatory Issues in Business, Montreal, Canada |
| 5-04-2017 / 7-04-2017 | Innovations in Insurance, Risk- and Asset Management. Munich, Germany |
| 9-02-2017 / 10-02-2017 | Actuarial and Financial Mathematics Conference (AfMath) 2017, Brussels, Belgium |
| 12-09-2016 / 16-09-2016 | Extremes and Risks in Higher Dimensions, Lorentz Center Leiden, Netherlands |
| 27-05-2016 | Recent developments in dependence modelling with applications in finance and insurance, Brussels, Belgium |
| 17-05-2016 / 19-05-2016 | Dependence Modeling in Finance, Insurance and Environmental Science, Munich, Germany |
| 26-04-2016 | Abteilung für Mathematische Stochastik Albert-Ludwigs-Universität Freiburg, Germany |

- 25-01-2016 Workshop on "Finance and Insurance, University of Zurich, Switzerland
- 29-05-2015 Recent developments in dependence modelling with applications in finance and insurance, Bruxelles, Belgium
- 4-03-2015 Séminaires Département de sciences actuarielles, UNIL Lausanne, Switzerland
- 15-12-2014 / 18-12-2014 CRM-CANSSI Workshop on New Horizons in Copula, Montreal, Canada
- 27-11-2014 LUH-Kolloquium "Versicherungs- und Finanzmathematik, Hannover, Germany
- 30-10-2014 Wien Seminar in Mathematical Finance and Probability, Wien, Austria
- 17-10-2014 / 18-10-2014 Workshop on Risk and Regulation, Freiburg, Germany
- 23-05-2014 Recent developments in dependence modelling with applications in finance and insurance, Bruxelles, Belgium
- 15-04-2014 ETH RISK CENTER Seminar Series, ETH Zurich, Switzerland
- 6-12-2013 Dept. Statistics and Actuarial Science Seminar, University of Waterloo, Canada
- 22-04-2013 WG on Risk Analysis, ESSEC Business School, Paris, France
- 06-02-2013 Finance and Stochastics seminar Imperial College, London, UK
- 30-07-2012 / 03-08-2012 ISAM-TopMath Summer School, Munich, Germany
- 10-07-2012 / 11-07-2012 Copulae in Mathematical and Quantitative Finance, Cracow, Poland
- 21-06-2012 Invited talk for the Italian Institute of Actuaries, Roma, Italy
- 13-04-2012 Risk and Dependence in Economics and Finance, Bolzano-Bozen, Italy
- 1-03-2012 Talks in Financial and Insurance Mathematics ETH Zurich, Switzerland
- 17-10-2011 IFOR Optimization and Applications Seminar, ETH Zurich, Switzerland
- 16-09-2011 Journées d'études de l'Institut des Actuaire et du SACEI - Deauville, France
- 28-04-2010 / 30-04-2010 Spatio-temporal risk modeling, CIRM Luminy, France
- 18-06-2010 FDM-Seminar, Freiburg, Germany
- 16-03-2008 / 22-03-2008 The Mathematics and Statistics of Quantitative Risk Management, Oberwolfach, Germany
- ORGANIZZAZIONE DI
CONVEGNI DI
CARATTERE
SCIENTIFICO (dal 2012)**
- 13-09-2018 / 14-09-2018 Recent Developments in Dependence Modelling with Applications in Finance and Insurance, Aegina Island. Componente del comitato organizzativo. (<http://www.vub.ac.be/events/2018/recent-developments-in-dependence-modelling-with-applications-in-finance-and-insurance>)
- 15-03-2018 / 16-03-2018 Model Uncertainty and Robust Finance, 2nd edition. Milan, Italy. Componente del comitato organizzativo e scientifico. (<https://sites.google.com/site/murf2018/>)

- 22-05-2017 / 23-05-2017 Recent Developments in Dependence Modelling with Applications in Finance and Insurance, Aegina Island. Componente del comitato organizzativo.
(<http://www.vub.ac.be/en/events/2017/recent-developments-in-dependence-modelling-with-applications-in-finance-and-insurance>)
- 25-01-2017 / 26-01-2017 XVIII Workshop in Quantitative Finance, Milano. Componente del comitato organizzativo.
- 10-11-2016 / 11-11-2016 Model Uncertainty and Robust Finance, Milan, Italy. Componente del comitato organizzativo e scientifico. <https://sites.google.com/site/2016murf/>
- 27-05-2016 Recent Developments in Dependence Modelling with Applications in Finance and Insurance, Brussels. Componente del comitato organizzativo.
(<http://www.vub.ac.be/events/2016/recent-developments-in-dependence-modelling-with-applications-in-finance-and-insurance>)
- 12-11-2015 / 13-11-2015 Dependence & Risk Measures, Milan, Italy. Componente del comitato organizzativo e scientifico. (<https://sites.google.com/site/dependenceriskmeasures/>).
- 18-12-2014 / 19-12-2014 Dependence in Risk Measurement and Risk Management, Firenze, Italy. Componente del comitato organizzativo e scientifico. (<https://sites.google.com/site/dependencerisk/>).
- 04-04-2013 / 09-04-2013 GEOX week on Risk Management, Firenze, Italy.), Organizzatore. (<https://sites.google.com/site/geoxweek>).
- 27-09-2012 Finance & Risk Management Workshop, Firenze, Italy. Organizzatore. (<https://sites.google.com/site/firmworkshop>).

Fondi di Ricerca Ottenuti

- 14-03-2017 / 13-03-2018 Componente dell'unità di ricerca del progetto *Bounds for Risk Functionals in dependence models* finanziato dallo GNAMPA
- 01-02-2013 / 01-02-2016 Componente dell'unità di ricerca del progetto PRIN 2010-11 cofinanziato "Decisioni robuste nei mercati e nelle organizzazioni".
- 09-02-2007 / 09-02-2009 Componente dell'unità di ricerca del progetto PRIN 2006 cofinanziato "Analisi e stima di modelli stocastici per la valutazione del rischio di credito e di corporate bonds".

Incarichi Editoriali

- 23/04/2013-oggi **Editor-in-Chief della rivista internazionale *Dependence Modeling*, indicizzata in SCOPUS, WoS (ESCI), MathSciNet, zbMATH.** (<http://www.degruyter.com/view/j/demo?recentIssue>)
- 2013-oggi Fondatore del REFEREE+ project (<https://sites.google.com/site/refereepplus/>)
- 2014-oggi Fondatore e curatore della mailing list Dependence Papers & Events (<https://sites.google.com/site/deppapersevents/>)
- 2015-oggi Fondatore e curatore del Rearrangement Algorithm project (<https://sites.google.com/site/rearrangementalgorithm/>)

Referee per progetti di ricerca

Fund for Scientific Research - F.R.S.-FNRS, Belgium

Referee per riviste internazionali

Journal of Multivariate Analysis (8), Finance & Stochastics (5), Insurance: Mathematics and Economics (5), Journal of Banking and Finance (3), Statistics and Probability Letters (3), 4OR - A Quarterly Journal of Operations Research (3), Quantitative Finance (2), Annals of Operations Research (3), Dependence Modeling (7), Journal of Risk and Insurance (2), Econometrica, Bernoulli, The Geneva Risk and Insurance Review, Financial Innovation, ASTIN Bulletin (2), Scandinavian Journal of Statistics, Mathematics of OR, Communications in Statistics - Simulation and Computation, Journal of Economics and Business, Statistics & Risk Modeling, Mathematical Programming SERIES A and B, RISKS, Journal of Nonparametric Statistics, Decisions in Economics and Finance, European Actuarial Journal.

2007-oggi Revisore per lo Zentralblatt MATH (37 reviews completate)

2018 Revisore per MathSciNet (1 review completata)

AFFILIAZIONI Membro Affiliato del RiskLab, ETH Zurigo dal 09-11-2016

ATTIVITÀ DIDATTICA

Dall'a.a. 2006/07 (insegnamenti con titolo in inglese sono stati insegnati in lingua)

2017/18 (U. Milano) Matematica - ECONOMIA E MANAGEMENT (EMA) 12 CFU.

Risk theory - ECONOMICS AND FINANCE (MEF) 6 CFU.

2016/17 (U. Milano) Mathematics - POLITICS AND ECONOMICS, 6 CFU.

Matematica - ECONOMIA E MANAGEMENT (EMA) 12 CFU.

2015/16 (U. Milano) Mathematics - POLITICS AND ECONOMICS, 6 CFU

Matematica - ECONOMIA E MANAGEMENT (EMA), 12 CFU

2013 (U. Waterloo, Canada) ACTSC634 Quantitative Risk Management at the Master of Actuarial Science.

2013/14 (U. Firenze) QUANTITATIVE RISK MANAGEMENT - FINANCE AND RISK MANAGEMENT, 6 CFU

2012/13 (U. Firenze) QUANTITATIVE RISK MANAGEMENT - FINANCE AND RISK MANAGEMENT, 6 CFU

2011/12 (U. Firenze) CALCOLO DELLE PROBABILITA' E STATISTICA - INFORMATICA, 6 CFU

MATEMATICA FINANZIARIA E TEORIA DEI MERCATI - ECONOMIA E COMMERCIO, 6 CFU (3 taught)

2009/10 (U. Firenze) CALCOLO DELLE PROBABILITA' E STATISTICA - INFORMATICA, 6 CFU

2008/09 (U. Firenze) PROBABILITA' E PROCESSI STOCASTICI - SCIENZE STATISTICHE, 9 CFU

2007/08 (U. Firenze) MATEMATICA FINANZIARIA - ECONOMIA E COMMERCIO, 6 CFU (3 taught)

METODI MATEMATICI - ECONOMIA AZIENDALE (0312), 9 CFU (3 taught)

2006/07 (U. Firenze) TEORIA DEL RISCHIO 2 - SCIENZE ATTUARIALI (0643), 6 CFU

Tesi di Dottorato supervisionate Philipp Arbenz (ETH Zurigo, Svizzera, co-supervisionato).

Tesi di Laurea supervisionate Davide Giammusso (Università di Trento), Antonela Beleraj (Università degli Studi di Firenze) e Giuseppe Cavallaro (Università degli Studi di Milano).

Attività di tutorato Tutor per il corso di Economia & Management per gli a.a. 2015/16-16/17-17/18

Attività gestionali, organizzative e di servizio presso l'Università degli Studi di Milano Membro della **Commissione per Pratiche Studenti e Piani di Studio** per il corso di Economia & Management, dal 2018

Membro della **Commissione Ricerca** del Dipartimento di Economia, Management e Metodi Quantitativi, dal 2018

Referente Open Access per il Dipartimento di Economia, Management e Metodi Quantitativi, dal 2018

Membro di commissioni bandi art. 23/45

**Altre esperienze
professionali**

09/26-04-2010 Organizzazione e produzione di un corso dal titolo “Risk in the Internal Models of operation of an insurance undertaking”, Polish Financial Supervision Authority, Warsaw, poland.

06-02-2015 Organizzazione e produzione del Webeminar “The Rearrangement Algorithm”, Deutsche Gesellschaft für Versicherungs-und Finanzmathematik (DGVM)

Dati personali

Autorizzo il trattamento dei miei dati personali ai sensi del Decreto Legislativo 30 giugno 2003, n. 196 (Codice in materia di protezione dei dati personali) e sue successive modifiche e integrazioni, nonché del Regolamento UE 679/2016 (Regolamento Generale sulla Protezione dei dati o, più brevemente, RGPD).

Data, 7/11/2018

Firma 