

ALLEGATO B

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI MILANO

selezione pubblica per n. 1 posto/i di Ricercatore a tempo determinato in tenure track (RTT) per il settore concorsuale 13/D4 _____ ,

settore scientifico-disciplinare_SECS/06_____

presso il Dipartimento di _____Dipartimento di Economia, Management e Metodi Quantitativi_____,

(avviso bando pubblicato sulla G.U. n. __16__ del _23/02/2024__) Codice concorso: 5498

[Corrado De Vecchi] CURRICULUM VITAE

(N.B. IL CURRICULUM NON DEVE ECCEDERE LE 30 PAGINE E DEVE CONTENERE GLI ELEMENTI CHE IL CANDIDATO RITIENE UTILI AI FINI DELLA VALUTAZIONE.

LE VOCI INSERITE NEL FACSIMILE SONO A TITOLO PURAMENTE ESEMPLIFICATIVO E POSSONO ESSERE SOSTITUITE, MODIFICATE O INTEGRATE)

INFORMAZIONI PERSONALI (NON INSERIRE INDIRIZZO PRIVATO E TELEFONO FISSO O CELLULARE)

COGNOME	DE VECCHI
NOME	CORRADO
DATA DI NASCITA	██████████

TITOLI

TITOLO DI STUDIO

(indicare la Laurea conseguita inserendo titolo, Ateneo, data di conseguimento, ecc.)

Laurea Magistrale in Scienze Statistiche e Attuariali, Università degli studi di Trieste, conseguita il 22/11/2017. Voto finale: 110/110 e lode. Titolo tesi di laurea: ``Il rischio operativo nel settore bancario: modelli ed analisi empiriche``. Supervisor tesi: Prof. Nicola Torelli e Prof. Roberta Pappadà.

TITOLO DI DOTTORE DI RICERCA O EQUIVALENTI, OVVERO, PER I SETTORI INTERESSATI, DEL DIPLOMA DI SPECIALIZZAZIONE MEDICA O EQUIVALENTE, CONSEGUITO IN ITALIA O ALL'ESTERO

(inserire titolo, ente, data di conseguimento, ecc.)

Doctor in Economics, presso la Vrije Universiteit Brussel, dal 01/10/2018 al 08/06/2022.
Titolo della tesi di dottorato: ``Essays on Optimal Portfolio Choice and Model Risk Assessment``.
Supervisor : Prof. Carole Bernard e Prof. Steven Vanduffel.

Il titolo Doctor in Economics da me ottenuto è dichiarato equipollente al titolo di Dottore di Ricerca italiano dall'Università degli Studi di Udine.

CONTRATTI DI RICERCA, ASSEGNI DI RICERCA O EQUIVALENTI

(per ciascun contratto stipulato, inserire università/ente, data di inizio e fine, ecc.)

Dal 01/10/2022 ad oggi ho lavorato come ricercatore Post-Doc presso il Dipartimento di Matematica della Technical University of Munich, Monaco di Baviera, Germania.
L'attività di ricerca si svolge principalmente presso la Cattedra di Matematica Finanziaria.

ATTIVITÀ DIDATTICA A LIVELLO UNIVERSITARIO IN ITALIA O ALL'ESTERO

(inserire periodo [gg/mm/aa inizio e fine], anno accademico, ateneo, corso laurea, numero ore, ecc.)

Durante la mia attività lavorativa presso la Technical University of Munich (iniziata il 01/10/2022) sono stato Teaching Assistant per i seguenti insegnamenti:

- Actuarial Risk Theory, dal 20/10/2022 al 01/02/2023: 9 ore di lezioni frontali (esercitazioni), formulazione e correzione degli esami.
- Insurance Mathematics 1, dal 20/10/2023 al 15/03/2024: 42 ore di lezioni frontali (esercitazioni), formulazione e correzione degli esami.

DOCUMENTATA ATTIVITÀ DI FORMAZIONE O DI RICERCA PRESSO QUALIFICATI ISTITUTI ITALIANI O STRANIERI;

(inserire anno accademico, ente, corso, periodo, ecc.)

Nel Luglio 2020 ho completato la summer school in Functional Analysis and Mathematical Statistics offerta dalla Scuola Matematica Interuniversitaria, Perugia.

DOCUMENTATA ATTIVITÀ IN CAMPO CLINICO

(indicare, data, durata, ruolo, ente presso il quale si è prestata attività assistenziale, ecc.)

REALIZZAZIONE DI ATTIVITÀ PROGETTUALE

(indicare, data, progetto, ecc.)

ORGANIZZAZIONE, DIREZIONE E COORDINAMENTO DI GRUPPI DI RICERCA NAZIONALI E INTERNAZIONALI, O PARTECIPAZIONE AGLI STESSI

(per ciascuna voce inserire anno, ruolo, gruppo di ricerca, ecc.)

TITOLARITÀ DI BREVETTI

(per ciascun brevetto, inserire autori, titolo, tipologia, numero brevetto, ecc.)

--

ATTIVITÀ DI RELATORE A CONGRESSI E CONVEGNI NAZIONALI E INTERNAZIONALI

(inserire titolo congresso/convegno, data, ecc.)

<ul style="list-style-type: none">-AMASES XLVII conference, Settembre 2023, Milano, Italia. Organizzata dall'Università Milano-Bicocca.-26th Insurance: Mathematics and Economics conference, Luglio 2023, Edimburgo, UK. Organizzata dalla Heriot-Watt University.}-XXIV Quantitative Finance Workshop, Aprile 2023, Gaeta, Italia. Organizzata dalla Università degli studi di Cassino e del Lazio Meridionale.-11th Conference in Actuarial Science and Finance on Samos. Maggio 2022, Samos, Grecia. Organizzata da KU Leuven, Copenhagen University and New York University.-10th MAF conference. Aprile 2022, Salerno, Italia. Organizzata dall'Università di Salerno.- Modeling Uncertainty in Social, Economic, and Environmental Sciences. Marzo 2022, Lione, Francia. Organizzata dalla EM Lyon Business School.- AMASES XLV conference. Settembre 2021, online. Organizzata dall'Università di Reggio Calabria- 24th Insurance: Mathematics and Economics conference. Luglio 2021, online. Organizzata da University of Illinois Urbana-Champaign, Ulm University, e University of New South Wales.-10th AMaMeF conference. Giugno 2021, online, Italy. Organizzata dall'Università di Padova.- 5th Workshop on Recent Developments in Dependence Modelling with Applications in Insurance and Finance. Settembre 2019, Agistri, Grecia. Organizzata dalla Vrije Universiteit Brussel.- 23th Insurance: Mathematics and Economics conference. Luglio 2019, Monaco di Baviera, Germania. Organizzata dalla Technical University of Munich.
--

CONSEGUIMENTO DI PREMI E RICONOSCIMENTI NAZIONALI E INTERNAZIONALI PER ATTIVITÀ DI RICERCA

(inserire premio, data, ente organizzatore, ecc.)

<p>Premio come secondo miglior contributo presentato alla "11th Conference in Actuarial Science and Finance on Samos", conferenza organizzata da KU Leuven, Copenhagen University and New York University. Titolo della presentazione: "Robust assessment of life insurance products".</p>
--

POSSESSO DEL DIPLOMA DI SPECIALIZZAZIONE EUROPEA RICONOSCIUTO DA BOARD INTERNAZIONALI (relativamente a quei settori concorsuali nei quali è prevista)

(indicare diploma, data di conseguimento, ecc.)

--

TITOLI DI CUI ALL'ARTICOLO 24 COMMA 3 LETTERA A) E B) DELLA LEGGE 30 DICEMBRE 2010, N. 240
(indicare se contratto di tipologia A o B, Ateneo, data di decorrenza e fine contratto, ecc.)

PRODUZIONE SCIENTIFICA

PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE

(per ciascuna pubblicazione indicare: nomi degli autori, titolo completo, casa editrice, data e luogo di pubblicazione, codice ISBN, ISSN, DOI o altro equivalente)

Interessi di ricerca includono le seguenti tematiche: Valutazione del rischio di Modello, Misure di rischio, Modelli di Dipendenza stocastica, Ottimizzazione di Portafoglio e dominanza stocastica.

Articoli e Tesi di Dottorato:

- 1) C. Bernard, C. De Vecchi and S. Vanduffel (2023), The impact of correlation on (Range) Value-at-Risk, Scandinavian Actuarial Journal, 2023:6, 531-564.
<https://doi.org/10.1080/03461238.2022.2139630>.
- 2) C. De Vecchi (2022), Essays on Optimal Portfolio Choice and Model Risk Assessment, Ph.D. Thesis, Vrije Universiteit Brussel.
- 3) C. Bernard, C. De Vecchi and S. Vanduffel (2021), When do two- and three-fund theorems hold? Quantitative Finance, 21:11, 1869-1883. <https://doi.org/10.1080/14697688.2021.1905172>.
- 4) C. Bernard, C. De Vecchi and S. Vanduffel (2024), Robust assessment of life insurance products. Submitted (Working paper)
- 5) C. De Vecchi and M. Scherer (2023), Pricing insurance contracts with an existing portfolio acting as background risk. Submitted (Working paper)
- 6) V. Bignozzi and C. De Vecchi (2023), Risk bounds under tail risk. (Working paper).

Data

14/03/2024

Luogo

Verona