



ALLA MAGNIFICA RETTRICE
DELL'UNIVERSITA' DEGLI STUDI DI MILANO

COD. ID: 7068

Il sottoscritto chiede di essere ammesso a partecipare alla selezione pubblica, per titoli ed esami, per il conferimento di un assegno di ricerca presso il Dipartimento di Economics, Management, and Quantitative Methods (DEMM)

Responsabile scientifico: Prof. Rossini

[Ilaria Stefani]

CURRICULUM VITAE

INFORMAZIONI PERSONALI

Cognome	Stefani
Nome	Ilaria

OCCUPAZIONE ATTUALE

Incarico	Struttura
Post-doctoral researcher	Università di Milano-Bicocca

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

Titolo	Corso di studi	Università	anno conseguimento titolo
Laurea Magistrale o equivalente	Finanza LM 16	Sapienza, Università di Roma	2019
Dottorato Di Ricerca	Modelli per l'Economia e la Finanza	Sapienza, Università di Roma	2024



LINGUE STRANIERE CONOSCIUTE

lingue	livello di conoscenza
Inglese	Fluent

PREMI, RICONOSCIMENTI E BORSE DI STUDIO

anno	Descrizione premio
2024	Winner Best PhD Dissertation. Title of paper from the PhD thesis: Co-jumps and recursive preferences in portfolio choices, AMASES 2024, Ischia, Naples.

ATTIVITÀ DI FORMAZIONE O DI RICERCA

descrizione dell'attività
<ol style="list-style-type: none">15-25 September 2024, Summer School, <i>EURO Summer Institute, Decision-making under uncertainty for commodities and financial markets</i>, Ischia, Naples.21-26 July 2021, Summer School, <i>SoFiE School of Financial Econometrics</i>, Kellogg School of Management-Northwestern University.14-18 June 2021, Summer School, <i>From Networks to Neural Networks in Finance</i> organized by the QFinLab research group at Politecnico di Milano jointly with the Lake Como School of Advanced Studies and Fondazione Alessandro Volta

ATTIVITÀ PROGETTUALE

Anno	Progetto
2022	Avvio alla Ricerca 2022, Sapienza University of Rome, Financed amount: 1300 euro. Participation as Principal Investigator to the research project "Dynamic optimal portfolio allocation"
2022	Progetto di Ateneo 2022, Sapienza University of Rome, Financed amount: 10000 euro. Participation as Investigator to the research project "Friction meet incompleteness: no-arbitrage solutions for derivative pricing and investment opportunities"
2021	Progetto di Ateneo 2021, Sapienza University of Rome, Financed amount: 12000 euro. Participation as Investigator to the research project "Facing emerging risks: an actuarial perspective"

CONGRESSI, CONVEGNI E SEMINARI

Data	Titolo	Sede
31/03/2022-01/04/2022	XXIII Workshop on Quantitative Finance, (Speaker) "The impact of co-jumps on portfolio choice with recursive preference"	Tor Vergata University, Rome
16/06/2022-19/06/2022	The Society for Computational Economics, 28th International Conference, Computing	Southern Methodist University, Dallas, Texas (USA)



	in Economics and Finance (CEF), (Speaker) "The impact of co-jumps on portfolio choice with recursive preferences"	
03/07/2022-06/07/2022	EURO 2022	Aalto University, Espoo, Finland
22/09/2022-24/09/2022	AMASES 2022, (Speaker) "Optimal portfolio allocation with co-jump and recursive preferences"	University of Palermo, Palermo, Italy
20/04/2023-22/04/2023	XXIV Workshop on Quantitative Finance, (Speaker) "Co-Jumps and recursive preferences in portfolio choices under ambiguity"	Gaeta, Italy
03/07/2023-07/07/2023	26th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics (IME), (Speaker) "Co-Jumps and recursive preferences in portfolio choices under ambiguity"	Edinburgh, Italy
20/09/2023-22/09/2023	AMASES 2023, (Speaker) "Robust optimal consumption and portfolio choice in complete markets with co-jumps"	Milan, Italy
11/04/2024-13/04/2024	XXV Quantitative Finance Workshop, (Speaker) "Optimal dynamic pension funds management with volatility and interest rate risk"	Bologna, Italy
08/07/2024-11/07/2024	27th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics (IME), (Speaker) "Analyzing the term structure and determinants of the greenium effects"	Chicago, Illinois
05/09/2024-07/09/2024	AMASES 2024, (Speaker) "Analyzing the term structure and determinants of the greenium effects"	Ischia, Naples

PUBBLICAZIONI

Articoli su riviste
Oliva I. and Stefani, I. Robustness meets co-jumps: optimal consumption and portfolio choice with derivatives, Quantitative Finance, 2024, doi.org/10.1080/14697688.2024.2410862
Oliva I. and Stefani, I. Co-jumps and recursive preferences in portfolio choices, Annals of Finance, 2023, doi.org/10.1007/s10436-023-00425-2, issn: 1614-2446.
Stefani I. An overview on dynamic optimal portfolio allocation, Annali del dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza (MEMOTEF), doi.org/10.13133/2611-6634/1415.
Oliva, I. and Stefani, I. and Torricelli, L. Dynamic portfolio choice in complete markets with co-jumps,



under review
Mercuri, L. and Rroji, E. and Stefani, I. Analyzing the term structure and determinants of the greenium effect, under review
Cornaro, A. and Rroji, E. and Stefani, I. A network analysis of systemic risk in the European banking sector, under review.
Mancinelli, D. and Oliva, I. and Stefani, I. Optimal management of DC pension funds in a carbon-penalized setting: an optimal control approach, working progress.

ALTRE INFORMAZIONI

n.a
n.a

Le dichiarazioni rese nel presente curriculum sono da ritenersi rilasciate ai sensi degli artt. 46 e 47 del DPR n. 445/2000.

Il presente curriculum, non contiene dati sensibili e dati giudiziari di cui all'art. 4, comma 1, lettere d) ed e) del D.Lgs. 30.6.2003 n. 196.

RICORDIAMO che i curricula **SARANNO RESI PUBBLICI sul sito di Ateneo** e pertanto si prega di non inserire dati sensibili e personali. Il presente modello è già precostruito per soddisfare la necessità di pubblicazione senza dati sensibili.

Si prega pertanto di **NON FIRMARE** il presente modello.

Luogo e data: Milano, 22/01/2025