

ROSELLA CASTELLANO

Curriculum breve

ATTUALI POSIZIONI

Professore Ordinario di Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, Dipartimento di Scienze Giuridiche ed Economiche - Università degli Studi di Roma UnitelmaSapienza (dal 2017).

Direttore del Dipartimento di Scienze Giuridiche ed Economiche - Università degli Studi di Roma UnitelmaSapienza (dal 2021).

Consigliere di amministrazione indipendente della Banca Monte dei Paschi di Siena e componente dei comitati endoconsiliari "Rischio e Sostenibilità", e "Nomine" (dal 2020).

Componente del Collegio dei Docenti del Dottorato di Ricerca in Scienze Sociali Applicate, Scuola di Dottorato Sapienza Università di Roma (dal 2013)

Componente del Minerva Lab, laboratorio interdisciplinare sulle disuguaglianze di genere, di Sapienza Università di Roma (dal 2018)

PRECEDENTI POSIZIONI

Italia

Professore Associato di Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, Dipartimento di Scienze Giuridiche ed Economiche – Università degli Studi di Roma UnitelmaSapienza (2014-2017).

Professore Associato di Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie – Dipartimento di Economia e Diritto - Università di Macerata (2005-2014).

Direttrice di Sezione (f.f.) – c/o Presidenza del Consiglio dei Ministri (2000 – 2005).

Ricercatore - Facoltà di Economia- Università di Macerata (1996-2000).

Estero

Visiting Professor presso Univerdidad de Leon, Leon – SP, 2019

Visiting Professor presso Institute Universitaire de Technologie , Valence – FR, 2011

Visiting Scholar, Decision Sciences Department, "The Wharton School" of the University of Pennsylvania (1991 -1993), Philadelphia (USA).

ATTUALI CORSI DI INSEGNAMENTO

I Livello: **Metodi Quantitativi per la Gestione Aziendale.**

II Livello: **Misura dei Rischi Finanziari; Modelli Computazionali per l'Economia e la Finanza; Artificial Economics, Simulation and Computational Methods; Finanza Sostenibile.**

Master: **Modelli Computazionali per l'Analisi e la Classificazione dei Big Data; Machine Learning e Big Data.**

INCARICHI ISTITUZIONALI PREGRESSI (SELEZIONE)

Università di Roma UnitelmaSapienza: **Presidente Commissione Paritetica Docenti Studenti; Coordinatrice Commissione di Valutazione “Economia”; Componente Commissione di Valutazione “Titoli Stranieri”; Delegata del Rettore** al Job Placement.

Sapienza Università di Roma e LUISS: **Componente del Comitato Scientifico e Organizzatore** dell’International Summer School “Risk Measurement and Control” (dal 2012).

Università degli Studi di Roma Tor Vergata: **Componente** del Collegio dei Docenti del Dottorato di Ricerca in Economia delle istituzioni e dei mercati monetari e finanziari (2008-2013).

Università di Macerata: **Direttrice** della Summer School in Economia e Legislazione Antiriciclaggio; **Delegata del Rettore** al Polo Interdisciplinare di Ricerca “Secure, Clean and Efficient Energy”; **Delegata del Direttore del Dipartimento di Economia e Diritto** alla Pianificazione Strategica e Rendicontazione Sociale dell’Ateneo; **Componente** del Comitato Scientifico del Centro di Ricerca Maffeo Pantaleoni per gli studi bancari, finanziari e assicurativi; **Componente** del Comitato Scientifico del Laboratorio “Fausto Vicarelli”, per lo studio del rapporto tra Banca e Industria.

TEMI DI RICERCA

- Rischio di Credito ed integrazione dei criteri ESG, rischio di transizione
- Modelli di ottimizzazione per la gestione aziendale, logistica e trasporti
- Modelli quantitativi per l’analisi dei mercati delle materie prime.
- Modelli quantitativi per l’analisi di fenomeni economico-finanziari
- Network Analysis
- Analisi e misura dei rischi finanziari.
- Strumenti Derivati per la gestione dei rischi finanziari.
- Definizione strategie di investimento ottimo e diversificazione.
- Modelli complessi per la soluzione di problemi di valutazione della redditività degli strumenti finanziari e definizione strategie di gestione del rischio.
- Valutazione di strumenti finanziari complessi.
- Finanza comportamentale e Financial Literacy.

ULTERIORI ATTIVITA' (SELEZIONE)

Membro Commissioni di Concorso

- Concorso per la selezione di Esperti in Mercati Finanziari e Gestione dei Rischi (2018, 2021) – Banca d’Italia
- Concorso per l’Esame di Stato Attuario Senior e Junior - Sede di Roma (2019)
- Concorsi per l’accesso ai ruoli accademici (tutte le fasce della docenza)
- Concorsi per l’ammissione a Dottorati di Ricerca.

Incarichi in qualità di Esperto (Selezione)

- Consulente Tecnico per l’integrazione dei criteri ESG nelle strategie di impresa, dal 2021.
- Consulente Tecnico per la valutazione di strumenti di finanziamento adottati da imprese private, dal 2014.
- Consulente Tecnico per la Financial Literacy, CGIL Firenze, 2017
- Consulente Tecnico per la valutazione degli expected payoff delle VLT, 2012.
- Consulente Tecnico per l’implementazione di un algoritmo per la misurazione delle performance di Fondi Comuni di Investimento, 2000.

Coordinamento di Progetti (Selezione)

- *Management Committee Sub* Progetto europeo COST Action CA15122, Reducing Old-Age Social Exclusion: Collaborations in Research and Policy (ROSEnet) dal 4 aprile 2016 al 04-aprile-2020.
- *Progetto di Ricerca di Ateneo*: Modelli per la sostenibilità in ambito bancario 2023.2024.
- *Progetto di Ricerca di Ateneo*: Realtà Virtuale Aumentata, Teoria dei prospetti e finanza comportamentale, 2018, 2019.
- *Progetto di Ricerca di Ateneo*: Modelli quantitativi per l’analisi dei mercati delle materie prime 2016, 2017.
- *Progetto di Ricerca di Ateneo*: Metodi quantitativi per il conformance checking in ambito aziendale, 2014, 2015.
- *Progetti di Ricerca del Dip. di Economia e Diritto dell’Università di Macerata*: Dinamiche complesse per i mercati dei derivati 2010, 2012, 2013.
- *Progetto UE/EYE* Economia e Legislazione Antiriciclaggio, 2006-2008.

Attività di Referaggio e Valutazione (Selezione):

The International Journal of Management Science; Journal of Banking and Finance; The European Journal of Finance; Applied Financial Economics; Journal of the Operational Research Society, Omega, Computers

& Operations Research; Journal of Economic Dynamics and Control; European Journal of Operational Research; Central European Journal of Operations Research; Applied Economics; International Review of Financial Analysis; Research in International Business and Finance; South Eastern Journal of Economics; Frontiers in Finance and Economics, International Society for Intercommunication of New Ideas (ISINI) and - Lille Graduate School of Management (Group ESC); Rivista di Statistica Applicata; Rivista Italiana degli Economisti; Rivista di Politica Economica; Sustainability; Classification, Data Analysis and Knowledge Organization; Progetti di Ateneo dell'Università degli Studi di Siena; Premio «Angelo Costa»; Premio SIE per Tesi di dottorato, Società Italiana degli Economisti..

Responsabilità Scientifica di convegni nazionali e internazionali (Selezione).

- Euro Working Group on Financial and Commodities Modeling, Roma 2023
- International Summer School on Risk Measurement and Control, iniziativa permanente in collaborazione con Sapienza Università di Roma, LUISS e pool di Università europee, dal 2004
- XVIII International Conference on Finance and Banking, 2020.
- V Energy Finance Italia, Roma 2020.
- 50° Convegno dell'Euro Working Group for Commodity and Financial Modelling, Roma 2012.
- 30° Convegno dell'Euro Working Group for Financial Modeling (2002)
- XII "Annual European Futures Research Symposium" del Chicago Board of Trade, tenutosi a Roma dal 13-14 settembre 1999.

PARTECIPAZIONE A CONVEGNI E SEMINARI E ATTIVITA' EDITORIALE

Partecipazione a più di 100 conferenze internazionali e seminari sia come relatrice che come speaker invitata o in sessione plenaria.

Guest Editor di riviste internazionali (Annals of Operation Research, Quality&Quantity, ecc.)
Membro dell'Advisory Board della sezione "Financial Mathematics" della rivista Mathematics

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

Dottorato di Ricerca in Matematica per l'Analisi dei Mercati Finanziari Università degli Studi di Brescia	1994
Scuola di Perfezionamento in Economia Bancaria e dei Mercati Finanziari Int.li Università degli Studi di Roma "La Sapienza"	1991
Laurea in Scienze Politiche (Indirizzo Economico) Università degli Studi di Roma "La Sapienza"	1990

ARTICOLI SCIENTIFICI IN RIVISTA DI FASCIA A - ULTIMI 15 ANNI

1. Ventre V, and Martino R, and Castellano R, and Sarnacchiaro P, The analysis of the impact of the framing effect on the choice of financial products: an analytical hierarchical process approach, ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH, <https://doi.org/10.1007/s10479-022-05142-z>, <https://link.springer.com/article/10.1007/s10479-022-05142-z>, 2023.
2. Castellano R, and Corallo V, Morelli G., Structural estimation of Counterparty Credit Risk under recovery risk, JOURNAL OF BANKING & FINANCE, 10.1016/j.jbankfin.2022.106512, 2022.
3. Castellano R, and Cerqueti R, and Clemente G, and Grassi R, An optimization model for minimizing systemic risk, MATHEMATICS AND FINANCIAL ECONOMICS, doi 10.1007/s11579-020-00279-6, <https://link.springer.com/content/pdf/10.1007/s11579-020-00279-6.pdf>, 2021.
4. Castellano R, and Mancinelli M, and Ponsi G, and Tieri G, What if versus probabilistic scenarios: a neuroscientific analysis, ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH, doi 10.1007/s10479-019-03272-5, <https://link.springer.com/article/10.1007/s10479-019-03272>, 2021.
5. Castellano R, and Cerqueti R, and Rotundo G., Exploring the financial risk of a temperature index: a fractional integrated approach, ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH, doi 10.1007/s10479-018-3063-0, 2020.
6. Castellano R, and Ferrari A, Are Stock Price Dynamics Affected by Financial Analysts' Recommendations? Evidence from Italian Green Energy Stocks, QUALITY & QUANTITY, doi 10.1007/s11135-018-0780-z, 2019.
7. Castellano R, and Cerqueti R, A theory of misperception in a stochastic dominance framework and its application to structured financial products, IMA JOURNAL OF MANAGEMENT MATHEMATICS, doi 10.1093/imaman/dpw007, <http://imaman.oxfordjournals.org/content/early/2016/06/29/imaman.dpw007.full.pdf+html>, 2016.
8. Ausloos M, and Castellano R, and Cerqueti R, Regularities and Discrepancies of Credit Default Swaps: a Data Science approach through Benford's Law, CHAOS, SOLITONS AND FRACTALS, doi 10.1016/j.chaos.2016.03.002, <http://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S0960077916300832>, 2016.
9. Castellano R, and Cerqueti R, and Spinesi L., Sustainable Management of Fossil Fuels: A Dynamic Stochastic Optimization Approach with Jump-Diffusion. EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONAL RESEARCH, doi 10.1016/j.ejor.2016.04.052, <http://dx.doi.org/10.1016/j.ejor.2016.04.052>, 2016.
10. Castellano R, and Cerqueti R, Mean-variance portfolio selection in presence of infrequently traded stocks, EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONAL RESEARCH, doi 10.1016/j.ejor.2013.04.024, http://ac.els-cdn.com/S0377221713003226/1-s2.0-S0377221713003226-main.pdf?_tid=277a0b8e-b0c7-11e6-a27e-00000aab0f27&acdnat=1479828188_c95dc8584acb2b3da5025da5f29a6ad1, 2014.

11. Castellano R, and Cerqueti R, Roots and Effects of Financial Misperception in a Stochastic Dominance Framework, *QUALITY & QUANTITY*, doi 10.1007/s11135-012-9726-z}, <http://link.springer.com/article/10.1007%2Fs11135-012-9726-z>, 2013.
12. Castellano R, and D'Ecclesia RL, CDS Volatility: the Key Signal of Credit Quality, *ANNALS OF OPERATIONS RESEARCH*, doi 10.1007/s10479-012-1244-9, <http://link.springer.com/search?query=castellano+d%27ecclesia&search-within=Journal&facet-journal-id=%2210479%22>, 2013}
13. Castellano R, and Cerqueti R, Optimal consumption/investment problem with light stocks: A mixed continuous-discrete time approach, *APPLIED MATHEMATICS AND COMPUTATION*, doi 10.1016/j.amc.2011.12.065, <http://www.elsevier.com/locate/amc>, 2012.
14. Castellano R, and Giacometti R, Credit Default Swaps: Implied Ratings versus Official Ones, *4OR*, doi 10.1007/s10288-011-0195-3, <http://www.springer.com/home?SGWID=0-0-1003-0-0&aqId=2174152&download=1&checkval=ae010e0721753ea0cb5c9915168688f4>, 2012.
15. Castellano R, and Cerqueti R, The optimal bid/ask spread in a Specialist System, *ECONOMIC MODELLING*, doi 10.1016/j.econmod.2011.06.019, <http://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S0264999311001519>, 2011.

ARTICOLI SCIENTIFICI IN RIVISTA - ULTIMI 10 ANNI

1. Brunelli S., and Carlino C., and Castellano R, and Giosi A.}, Going Concern Modifications and Related Disclosure in the Italian Stock Market: Do Regulatory Improvements Help Investors in Capturing Financial Distress? *THE JOURNAL OF MANAGEMENT AND GOVERNANCE*, doi 10.1007/s10997-020-09537-7, <https://link.springer.com/article/10.1007/s10997-020-09537-7>, 2021.
2. Castellano R, and Cerqueti R, and D'Ecclesia RL, A Disutility-Based Drift Control for Exchange Rates, *OPTIMIZATION*, doi 10.1080/02331934.2011.641016, http://www.tandfonline.com/doi/full/10.1080/02331934.2011.641016#.UbdFjpwV_84, 2014.
3. Castellano R, and Scaccia L, Can CDS indexes signal future turmoils in the stock market? A Markov switching perspective, *CENTRAL EUROPEAN JOURNAL OF OPERATIONS RESEARCH*, doi 10.1007/s10100-013-0330-7, <http://link.springer.com/article/10.1007/s10100-013-0330-7>, 2014.
4. Castellano R, and Scaccia L, CDS and Rating Announcements: changing signaling during the crisis? *REVIEW OF MANAGERIAL SCIENCE*, doi 10.1007/s11846-012-0086-9, <http://link.springer.com/article/10.1007/s11846-012-0086-9>, 2012.

CONTRIBUTI IN VOLUME - ULTIMI 10 ANNI

1. Castellano R, and Rinaldi A, and Tieri G, Financial literacy and education: how technology can help involving the children, in *International, Technology, Education and Development* isbn 978-84-09-08619-1, doi 10.21125/inted.2019, 2019
2. Castellano R, and Mancinelli M, and Sarnacchiaro P, A statistical investigation on the relationships among financial disclosure, sociodemographic variables, financial literacy, and risk assessment ability, in *Smart Statistics for Smart Applications: Book of Short Paper SIS 2019*, Eds. Arbia G Peluso S Pini A Rivellini G, Pearson Milano, 2019.
3. Castellano R, and Mancinelli M, and Sarnacchiaro P, A statistical model for the investigation of the retail investors' risk assessment ability, Eds Matilde Bini Pietro Amenta Antonello D'Ambra Ida Camminatiello, in *Statistical Methods for Service Quality Evaluation*, Cuzzolin Editore, NAPOLI, 2019.
4. Castellano R, and Cerqueti R, in Silvestrelli P, Sustainability and ethic view of the future generations, in *Sustainable development for territories. Threats and opportunities*, Eum, MACERATA - ITA, 2015.
5. Castellano R, and Cedrola E, in *Monte Carlo/Monte Carlo Markov Chain Method*, Ed Cooper G, Jhon Wiley & Sons Ltd, Wiley Encyclopedia of Management, doi 10.1002/9781118785317.wcom09017, <http://onlinelibrary.wiley.com/doi/10.1002/9781118785317.wcom09017/abstract>, 2015

La sottoscritta Rosella Castellano autorizza al trattamento dei dati personali ai sensi del D.L. 196/2003.

Roma, 01 marzo 2023

Rosella Castellano