

RITA LAURA D'ECCELESIA

INFORMAZIONI PERSONALI

Data di nascita: [REDACTED]
Indirizzo: [REDACTED]
Telefono: [REDACTED]
Email: [REDACTED]

ATTUALE POSIZIONE

Professore di Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie - Facoltà di Ingegneria, Statistica e Informatica - "Sapienza" Università di Roma (dall'a.a. 2004-2005).

Consigliere Indipendente (Vice presidente Vicario) nel CdA di Banco Monte dei Paschi di Siena..Maggio 2020-2023. Membro del Comitato Rischi e Sostenibilità di Banco MPS triennio 2020-23.

Presidente di Lumen Venture. Società d'Investimento Semplice. Luglio 2021-

Corsi di insegnamento:

I Livello: **Matematica Finanziaria**, Sapienza Università di Roma

II Livello: **Finanza Quantitativa, Asset Pricing, Teoria del Rischio**, Sapienza Università di Roma; **Commodity Asset Pricing** (Luiss Università)

Master: MBA: **Energy Markets** (ESCP London), **Electricity and Renewables** (ESCP, London);

MSc in Finance: **Commodity Pricing** (Birkbeck University of London UK).

Dottorato: **Finance, Asset Pricing** Sapienza Università di Roma

Alta Formazione: **Trainer in Risk Management per l'Energy Forum di Stoccolma** (2006-2007,2008,2009) in varie sedi Europee, **Trainer in Commodity Pricing and Risk Management per Marcus Evans**, Londra (2006- 2007-2008, 2011), Cina (2008), Brasile (2009) .

PRECEDENTI POSIZIONI

Visiting Professor Birkbeck, University of London (2008-2016).

Professore Associato di Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie - Facoltà di Economia - Università di Foggia (1998-2001).

Ricercatore Universitario- Facoltà di Economia- Università di Urbino (1993-1998).

Consulente statistico- ISIS, Istituto per l'Informatica e i Sistemi, **Roma** (1984-1990)

Collaboratore a Progetto CENSIS, Roma (1982-1985)

Consigliere Indipendente nel CdA di Igea Banca Dicembre 2015- Dicembre 2016

Consigliere indipendente nel CdA di Banco BPM triennio 2017-21

INCARICHI ISTITUZIONALI

Coordinatore Dottorato di Ricerca in *Economia e Finanza* dal XXIV ciclo (2008-2021).

Presidente di Corso di Studio in *Statistica, Economia, Finanza e Assicurazioni*. 2019-2022

Presidente dell'Euro Working Group for Commodities and Financial Modelling (Gruppo di Ricerca Operativa appartenente all'associazione EURO).

Presidente del Comitato Scientifico e Organizzatore dell'International Summer School on Risk Measurement and Control.

Presidente Commissione Programmazione e Bilancio di Facoltà per gli anni 2007-2010.

Coordinatore Commissione Ricerca di Dipartimento 2011-2013.

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

Dottore di Ricerca in Economia Aziendale: (III Ciclo) 1990

Curriculum : *Lo studio dei Mercati dei Capitali:*

UNIVERSITA' DEGLI STUDI DI BERGAMO

Laurea in Scienze Statistiche e Demografiche 1983

UNIVERSITA' "LA SAPIENZA", ROMA

Diploma di Licenza Scientifica 1978

ISTITUTO GUGLIELMO MARCONI, FOGGIA

TEMI DI RICERCA

- Misura della volatilità degli strumenti finanziari, utilizzo modelli tradizionali e vs. modelli di deep learning.
- Modellizzazione dei mercati delle commodities energetiche
- Mercato dei diamanti e suoi utilizzo nella gestione di portafoglio.
- Applicazione di metodi di ottimizzazione e calcolo stocastico per la modellizzazione di fenomeni economico-finanziario.
- 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.
- Rischio di Credito e Strumenti Derivati, Gestione del rischio e strategie di copertura. Pricing di strumenti complessi.
- Modelli di valutazione per i prezzi delle materie prime.
- Analisi relazioni tra i prezzi delle materie energetiche
- Il ruolo della finanziarizzazione nei mercati energetici, Il caso del Petrolio.
- Relazioni chiave tra i mercati dei combustibili fossili in US e in EU

ULTERIORI ATTIVITA'

Membro Commissioni di Concorso

- Concorso per la Valutazione Comparativa per 1 posto prof. II fascia nel SSD SECS-S06 presso l'Università di Catania (2005).
- Concorso per la selezione di 5 Esperti coadiutori in Metodi Quantitativi presso la CONSOB (2008-2009).
- Concorso per l'attribuzione della Borsa di Dottorato di Ricerca per gli anni 2010, 2012,2014, 2016.
- Concorso per 10 coadiutori in discipline Statistiche e/o Matematico-Finanziarie presso la Banca d'Italia 2015.
- Concorso per 7 coadiutori in discipline Matematico-Finanziarie presso la Banca d'Italia 2016.
- Concorso per 6 esperti in discipline Finanziario Attuariali presso l'IVASS 2016.
- Concorso per Professore Associato e Professore Ordinario del SSD 13/D4: Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Finanziarie ed Attuariali. ASN 2016. Presidente di Commissione da Dicembre 2016 ed effettivo per il biennio 2016-2018.
- Concorso per 1 posto Ricercatore a tempo determinato di tipo B presso Sapienza Università di Roma, nel SSD SSD 13/D4: Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Finanziarie ed Attuariali, 2018.
- Concorso per 1 posto Professore Associato, Art. 18 presso Sapienza Università di Roma, nel SSD SSD 13/D4: Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Finanziarie ed Attuariali, 2019, Presidente di Commissione.
- Concorso per 1 posto Professore Associato, presso Sapienza Università di Roma, nel SSD SSD 13/D4: Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Finanziarie ed Attuariali, 2019, Presidente di Commissione.

Incarichi in qualità di Esperto

- Tecnico di Parte per la valutazione di strumenti finanziari per la Cassa Di Garanzia e Compensazione in una controversia con BPM, Roma 2010.
- Consulente Tecnico di Parte nella controversia Lehman Brothers-Repubblica Italiana per la valutazione del mark-to-market per l'estinzione anticipata dei contratti esistenti al momento del default. 2011.
- Consulente Tecnico di Parte per la valutazione di strumenti di finanziamento adottati da imprese private, 2014.
- Esperto per la Comunità Europea per la Valutazione del "II Package for the Creation of a Single Market for Electricity and Gas"
- Gestore Mercato Elettrico 2003, esperto per la creazione di un mercato Futures su l'elettricità'.
- Progetto OECD-CERI per lo studio dell'impatto dell'Innovazione Tecnologica nel settore Italiano 1988

Coordinatore di Progetti

- *Laboratori Tecnico Scientifici* per l'Economia la Matematica e la Statistica, Progetto per l'Alta Formazione finanziato dalla Provincia di Roma per gli anni 2010 e 2011.
- *Progetto di Ricerca di Ateneo*: Dinamiche complesse per i mercati dei derivati 2010, 2012
- *Progetti di Facoltà annuali*.

Associate Editor:

Journal of Banking and Finance. Isini Frontiers in Finance and Economics. Isini Frontiers in Artificial Intelligence, Review of Managerial Science. European Journal of Finance. Mondo Bancario. International Journal of Financial Engineering and Risk Management, Journal of Finance and Risk Management, European Journal of Management and Business Economics.

Editor di Special Issue per riviste scientifiche

Journal of Banking and Finance (2009),
Journal of Energy Economics (2014), (2019)
Annals of Operation Research (2020)
European Journal of Operation Research (2008),
Central European Journal of Operation Research (2014),
Journal of International Risk Management (2012),
International Journal of Financial Engineering and Risk Management (2013).

Responsabile Scientifico di convegni nazionali e internazionali .

- Responsabile Scientifico del 61 Convegno dell'EURO Working Group for Commodities and Financial Modelling organizzato congiuntamente con FIDNES (Finance in Dynamic Network Societies), Curacao, Novembre 2019.
- Responsabile scientifico e organizzativo, dell'Annual Meeting di Commodities and Energy Markets Association 2018, Rome June 21-22 2018.
- Responsabile scientifico e organizzativo, dal 2004, dell' **International Summer School on Risk Measurement and Control**, iniziativa permanente in collaborazione con un pool di Università europee.
- **50° Convegno dell'Euro Working Group for Commodity and Financial Modelling**, Roma 2012.
- **30° Convegno dell'Euro Working Group for Financial Modeling** (2002) per il quale ha ricevuto finanziamenti dalle seguenti istituzioni:
 - EC –V Framework - High Level Scientific Conferences Funds;
 - CNR – Agenzia 2000 Fondi per le Altre Iniziative;
 - UBM- Unicredit.
 - **XII “Annual European Futures Research Symposium”** del Chicago Board of Trade, tenutosi a Roma dal 13-14 Settembre 1999.

LINGUE E COMPETENZE TECNICHE

Italiano: madrelingua.
Inglese: Eccellente
Spagnolo: Buono
Francese: Buono

ELENCO PUBBLICAZIONI ULTIMI 10 ANNI

Articoli su Riviste Internazionali

1. R. D'Ecclesia, M. Dwani. (2021) “International evidence on bank profitability: a survey” *Rivista Bancaria - Minerva Bancaria*. 3. Pp-45-67
2. R.L. D'Ecclesia, R. Cerqueti, S. Levantesi. (2021) Preface: recent developments in financial modelling and risk management. *Annals of Operations Research*. 299. 1-5.
3. R. D'Ecclesia, P. D'Urso, L. De Giovanni R. Massari, E. Maharaj: Cepstral-based clustering of financial time series ¶ *Journal of Expert Systems with applications*. 2020.

4. R.L. D'Ecclesia, V. Jotanovic. (2019). Do Diamond Stocks Shine Brighter than Diamonds? *Journal of Risk and Financial Management*, 12(2), 79 Special Issue on Alternative Assets and Cryptocurrencies.
5. R. L. D'Ecclesia, D. Clementi. (2021). Volatility in the stock market: ANN versus parametric models, *Annals of Operations Research*, vol. 299, issue 1, No 44, 1127
6. R.L. D'Ecclesia, E. Magrini, P. Montalbano, U. Triulzi. (2018) "Understanding recent oil prices Dynamics: A novel empirical approach", *Journal of Energy Economics*, <http://dx.doi.org/10.1016/j.eneco.2014.10.005>.
7. Con F. Barcellona, M. Panella, D. Stack, (2014) "Crude Oil Prices and Kernel-Based Models", *Special Issue on Commodity Risk Management in International Journal of Engineering and Financial Risk Management*, v. 1, n.3. 214-238.
8. con F. Barcellona, M. Panella, (2012) "Forecasting Energy Commodity Prices Using Neural Networks", *Advances in Decision Sciences*, Volume 2012 (2012), Article ID 289810, 26 page <http://dx.doi.org/10.1155/2012/28981>
9. con F. Barcellona e M. Panella, (2012) "Energy Commodity Price Forecasting Using Neural Networks", *Journal of Selected Topics in Signal Processing*
10. Con F. Barcellona, M. Panella, D. Stack (2012). Crude oil dynamics: an agent based model. *Journal of Financial Engineering and Risk Management Special Issue on Commodities Financial Management*. in Stampa.
11. con R. Castellano,(2012) "CDS Volatility: the Key Signal of Credit Quality", *Annals of Operational Research* 205:89–107 (DOI: 10.1007/s10479-012-1244-9)
12. con C. Bencivenga e U. Triulzi (2012), Oil prices and the financial crisis. *REVIEW OF MANAGERIAL SCIENCE*, vol. Volume 6, p. 227-238, ISSN: 1863-6683, doi: 10.1007/s11846-012-0083-z
13. (2012), Improving the European Commission's Prips Proposal. *Structured Products Risk Magazines*, 12, December
14. con F. Barcellona e M. Panella, V. Santucci (2011). Commodity Prices: a neural network approach. *IEEE SIGNAL PROCESSING LETTERS*, ISSN: 1070-9908
15. con C. Bencivenga, G. Sargenti, (2011) Integration of energy commodity prices in US and in Europe. *JOURNAL OF RISK MANAGEMENT IN FINANCIAL INSTITUTIONS*, vol. 4, p. 301-313, ISSN: 1752-8887
16. con R. Castellano, (2011) "Credit Default Swaps and Rating Announcements. *THE JOURNAL OF FINANCIAL DECISION MAKING*, vol. 6, p. 234-256, ISSN: 1790-4870
17. con R. Castellano, R. Cerqueti (2011) "A disutility based drift control for Exchange Rates" *Optimization*. August. p.1-15. 0233-1934, doi: 10.1080/02331934.2011.641016 (IF:0.91)

Editorials su Riviste Internazionali

- [1] con T. Vargiolu, (2019) Special Issue on Energy Markets Dynamics in a Changing Environment. *Energy Economics*, vol. 79 pag. 1-2.
- [2] (2016) Introduction to the special issue on recent developments in energy commodities markets, *Energy Economics*. vol. 53. Pag.1-4.
- [3] "Risk management in commodity Markets", *Central European Journal of Operations Research* 2, 2014, 1-3.
- [4] Con M. Brandtner (2012). Special Topic: Financial Crisis. *Review of Managerial Science*, vol. 6, p. 203-205, ISSN: 1863-6683, doi: 10.1007/s11846-012-0084-y
- [5] con D. Brigo (2011) "Risk Management", *Journal of Risk Management in Financial Institutions*. vol.4 p. 212-215, ISSN: 1752-8887

In manuali Internazionali

- [1] con M. Bertocchi (2012), *The Bond Market In Europe*. in "Eurobonds: Markets Infrastructures and Trends", World Scientific Series in Finance Vol. 7. p. 3-60
- [2] con M. Bertocchi (2012), *Market Infrastructures*. in "Eurobonds: Markets Infrastructures and Trends World Scientific Series in Finance Vol. 7, p. 61-82-52
- [3] con V. Moriggia, (2013) *Credit Rating Agencies*. in Eurobond: Markets, Infrastructures and Trend World Scientific Series in Finance Vol. 7, 132-170,.

- [4] (2013) *Introduction to Pricing in Energy Markets*, in Handbook of Risk Management in Energy Production and Trading. International Series in Operations Research and Management Science. Springer Verlag, 2013, pp. 30-60.
- [5] (2014) *Climate Futures Contracts* in The World Scientific Handbook of Futures Markets, World Scientific Handbook in Financial Economic Series Vol. 5 p. 345-375.
- [6] con D. Kondi, 2018, “Time Varying Correlation: A Key Indicator in Finance”. Pp. 69-87 , vol. 257. Handbook of Recent Advances in Commodity and Financial Modeling. Springer ISBN : 978-3-319-61318-5.

Manuali

- [1] con F. Barcellona (2012) Fondamenti per Abilità Informatiche. Giappichelli editore.
- [2] con L. Gardini. (2013) Appunti di Matematica Finanziaria I. Giappichelli Editore, Torino VII edizione.

Attività editoriale

- [1] Special Issue on Special Issue on Commodities Financial Management: Part 1, *International Journal of Financial Engineering and Risk Management*, Vol.1, n.1 February 2013
- [2] Special Issue on Financial Modelling. *Central European Journal of Operations Research*, Springer Verlag Vol. 2, 2014.
- [3] Special Issue on Recent Development in Economics, *Energy Economics*, Elsevier 2014
- [4] Special Issue on Energy Markets Dynamics in a Changing Environment, *Energy Economics*. 2018.
- [5] con S. Zenios, W. Ziemba (2019), Editors. *Collected works of Marida Bertocchi*. World Scientific Handbook in Financial Economics Series.
- [6] con R. Cerqueti e S. Levantesi. Special Issue on recent developments in Financial modelling. *Annals of operations Research* (2021).

La sottoscritta Rita Laura D'Ecclesia autorizza al trattamento dei dati personali ai sensi del D.L. 196/2003.

Roma 5 maggio 2021