

RITA LAURA D'ECCELESIA

INFORMAZIONI PERSONALI

Data di nascita: 30/09/1960

Indirizzo: Via L.Ungarelli 15

Telefono: 3474521307

Email: rita.decclesia@uniroma1.it

ATTUALE POSIZIONE

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

Visiting Professor presso il Birkbeck College, University of London (dall'a.a. 2008-2009).

Corsi di insegnamento:

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

II Livello: **Finanza Quantitativa**, 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: **PhD School of Economics: Inference, Finance**, 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

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)

INCARICHI ISTITUZIONALI

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

Presidente dell'Euro Working Group for Commodity and Financial Modeling (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.

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

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

UNIVERSITA' DEGLI STUDI DI BERGAMO

Curriculum : *Lo studio dei Mercati dei Capitali:*

Laurea in Scienze Statistiche e Demografiche 1983

UNIVERSITA' "LA SAPIENZA", ROMA

Diploma di Licenza Scientifica 1978

ISTITUTO GUGLIELMO MARCONI, FOGGIA

TEMI DI RICERCA

- 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.
- Concorso per 10 coadiutori in discipline Statistiche e/o Matematico-Finanziarie presso la Banca d'Italia 2015.

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"

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. Review of Managerial Science. European Journal of Finance. Mondo Bancario. International Journal of Financial Engineering and Risk Management, Journal of Finance and Management.

Editor di Special Issue per riviste scientifiche

Journal of Banking and Finance (2009),
 Journal of Energy Economics (2014),
 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 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 5 ANNI

Articoli su Riviste Internazionali

- [1] con E. Magrini, P. Montalbano, U. Triulzi. “Understanding recent oil prices Dynamics: A novel empirical approach”, *Journal of Energy Economics*, <http://dx.doi.org/10.1016/j.eneco.2014.10.005>.
- [2]. 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.
- [3] con F. Barcellona, M. Panella, (2012) “ Forecasting Energy Commodity Prices Using Neural Networks”, *Advances in Decision Sciences*, Volume 2012 (2012), Article ID 289810, 26 pages <http://dx.doi.org/10.1155/2012/289810>
- [4] con F. Barcellona e M. Panella, (2012) ” Energy Commodity Price Forecasting Using Neural Networks”, *Journal of Selected Topics in Signal Processing* in stampa .
- [5] 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.
- [6] 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)
- [7] 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
- [8] (2012), Improving the European Commission's Prips Proposal. *Structured Products Risk Magazines*, 12, December
- [9] con F. Barcellona e M. Panella, V.Santucci (2011). Commodity Prices: a neural network approach. *IEEE SIGNAL PROCESSING LETTERS*, ISSN: 1070-9908
- [10] 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
- [11] con R. Castellano, (2011) “Credit Default Swaps and Rating Announcements. *THE JOURNAL OF FINANCIAL DECISION MAKING*, vol. 6, p. 234-256, ISSN: 1790-4870
- [12] 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)
- [13] con C. Bencivenga, G. Sargenti, (2009) “Energy markets: crucial relationships between prices” edited by M. Corazza *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance* 143-53, Springer Verlag.

Editorials su Riviste Internazionali

- [1] “Risk management in commodity Markets”, *Central European Journal of Operations Research* 2, 2014, 1-3.
- [2] 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
- [3] 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 World Scientific Handbook in Financial Economic Series Vol. 5 p. 345-375.

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

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